

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
TÍTULOS PÚBLICOS	10.857.740,67	11,19%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.845.291,74	1,90%	6.413.203.187,61	0,03%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	554.649,70	0,57%	5.251.127.483,30	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	815.158,81	0,84%	1.042.570.269,57	0,08%	7º I b
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.381.329,02	2,45%	190.279.981,04	1,25%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	619.642,89	0,64%	5.336.453.186,66	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	754.420,60	0,78%	5.245.527.378,78	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.701.744,89	1,75%	7.718.818.121,25	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.445.333,63	13,86%	5.008.664.499,36	0,27%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.246.283,10	1,28%	8.572.761.910,40	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.995,15	0,04%	12.594.877.640,69	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.071.128,70	3,17%	2.310.441.680,03	0,13%	7º I b
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	789.782,25	0,81%	330.883.273,79	0,24%	7º I b
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.790.215,19	11,12%	742.916.287,32	1,45%	7º III a
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.851.588,49	5,00%	10.512.919.193,01	0,05%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.750.806,09	13,14%	157.509.729,68	8,10%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.316.192,29	1,36%	1.285.884.378,15	0,10%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.035,43	0,00%	2.799.993.446,09	0,00%	7º III a
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.708.430,91	1,76%	747.907.484,79	0,23%	8º I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.911.139,50	3,00%	257.891.315,18	1,13%	8º I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.935.710,37	2,00%	436.141.421,13	0,44%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	943.011,67	0,97%	1.385.717.145,06	0,07%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.393.790,36	3,50%	627.872.691,75	0,54%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.216.286,03	2,28%	250.783.572,35	0,88%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.291.929,60	1,33%	1.467.717.616,36	0,09%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.713.948,27	1,77%	1.517.600.997,51	0,11%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	791.474,08	0,82%	123.282.161,05	0,64%	8º I

Investimentos

\$ 97.025.811,90

Disponibilidades Financeiras

\$ 169.641,98

Total Carteira

\$ 97.195.453,88

Governança (Pró Gestão)

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	358.079,66	0,37%	250.999.664,51	0,14%	8º I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	218.030,65	0,22%	76.096.432,10	0,29%	8º I
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	1.069.478,11	1,10%	12.486.957,13	8,56%	9º II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	883.678,31	0,91%	709.646.976,36	0,12%	9º II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	1.238.684,85	1,28%	321.725.294,33	0,39%	9º II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.727.576,34	1,78%	2.108.221.544,73	0,08%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.393.616,74	1,44%	99.460.936,53	1,40%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	543.511,08	0,56%	1.444.877.997,30	0,04%	10º I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.858.096,73	5,01%	1.668.294.580,56	0,29%	10º I

Investimentos

 97.025.811,90

Disponibilidades Financeiras

 169.641,98

Total Carteira

 97.195.453,88

Governança (Pró Gestão)



Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	10/12/2021	Curva - Taxa: 5,0200%	29	4.547,603226	131.880,49
NTN-B - 15/05/2035	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,6800%	20	4.738,467729	94.769,35
NTN-B - 15/08/2040	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7500%	49	4.915,736289	240.871,08
NTN-B - 15/05/2045	26/03/2020	Curva - Taxa: 4,5500%	146	5.081,489918	741.897,53
NTN-B - 15/05/2045	09/09/2021	Curva - Taxa: 4,8600%	351	4.891,34431	1.716.861,85
NTN-B - 15/05/2045	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	72	4.951,559118	356.512,26
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2019	Curva - Taxa: 4,4000%	122	5.363,84326	654.388,88
NTN-B - 15/08/2050	31/03/2020	Curva - Taxa: 4,4600%	71	5.318,99851	377.648,89
NTN-B - 15/08/2050	02/04/2020	Curva - Taxa: 4,5900%	146	5.223,730217	762.664,61
NTN-B - 15/08/2050	06/04/2020	Curva - Taxa: 4,6800%	123	5.159,256693	634.588,57
NTN-B - 15/08/2050	08/04/2020	Curva - Taxa: 4,6300%	122	5.194,928175	633.781,24
NTN-B - 15/08/2050	09/04/2020	Curva - Taxa: 4,7300%	124	5.123,950964	635.369,92
NTN-B - 15/08/2050	15/05/2020	Curva - Taxa: 4,6400%	147	5.187,76445	762.601,37
NTN-B - 15/08/2050	23/11/2020	Curva - Taxa: 4,3400%	3	5.409,247151	16.227,74
NTN-B - 15/08/2050	10/03/2021	Curva - Taxa: 4,1500%	19	5.556,835019	105.579,87
NTN-B - 15/08/2050	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7800%	69	5.089,006784	351.141,47
NTN-B - 15/08/2050	15/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	29	4.414,578235	128.022,77
NTN-B - 15/05/2055	01/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	359	5.105,520347	1.832.881,80
NTN-B - 15/05/2055	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,8000%	134	5.075,007251	680.050,97

Investimentos

\$ 97.025.811,90

Disponibilidades Financeiras

\$ 169.641,98

Total Carteira

\$ 97.195.453,88

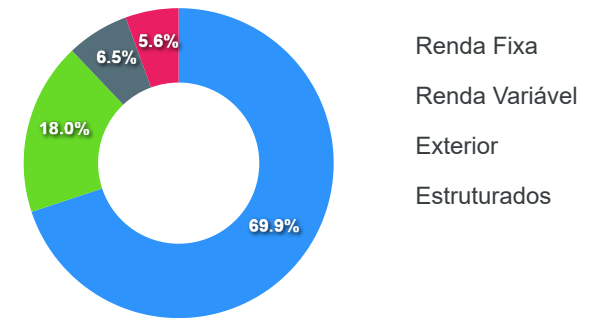
Governança (Pró Gestão)

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	11,17%	10.857.740,67 88,83%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	28,05%	27.261.760,48 71,95%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	30,57%	29.709.837,49 29,43%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	17,99%	17.481.831,10 12,01%
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,28%	3.191.841,27 6,72%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,21%	3.121.193,08 6,79%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	5,56%	5.401.607,81 4,44%

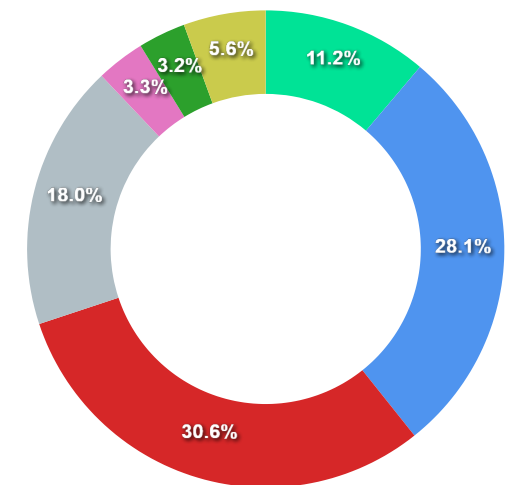
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos

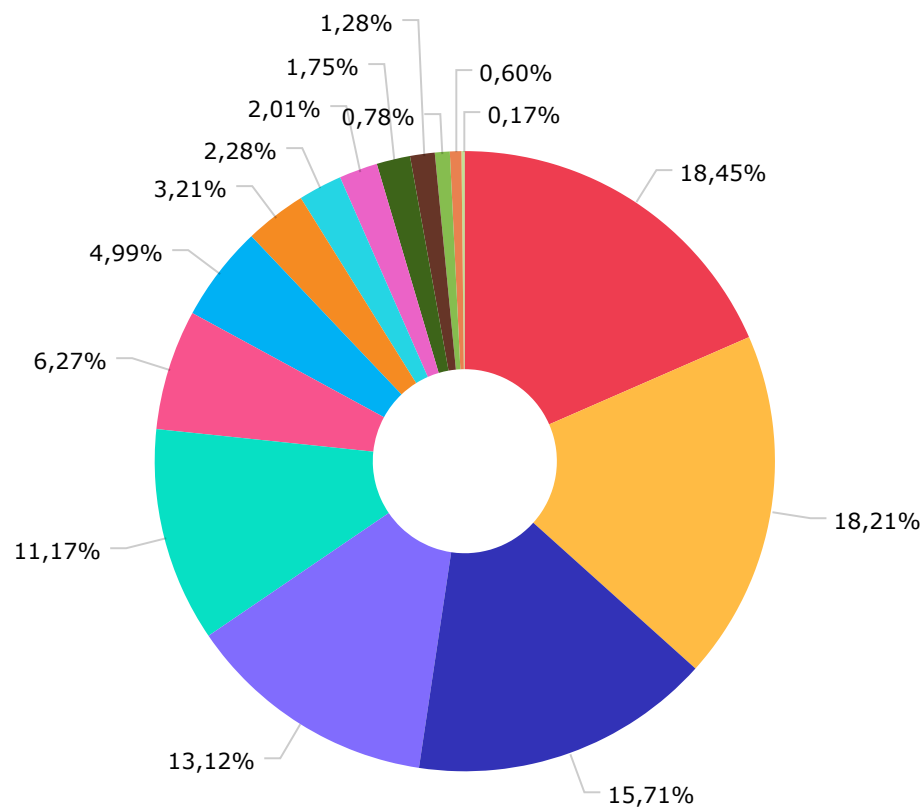


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	11,17%	0,00%	12,00%	100,00%	86.337.713,21	8º I - Fundos de Ações	17,99%	0,00%	20,00%	30,00%	11.676.805,06
7º I b - FI 100% Títulos TN	28,05%	0,00%	24,00%	100,00%	69.933.693,40	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	29.158.636,16
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	97.195.453,88	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	9.719.545,39
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.859.772,69	9º II - Constituídos no Brasil	3,28%	0,00%	2,00%	10,00%	6.527.704,12
7º III a - FI Referenciados RF	30,57%	0,00%	33,00%	60,00%	28.607.434,84	9º III - Ações - BDR Nível I	3,21%	0,00%	2,00%	10,00%	6.598.352,31
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	58.317.272,33	10º I - Fundos Multimercados	5,56%	0,00%	2,00%	10,00%	4.317.937,58
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	19.439.090,78	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.859.772,69
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.859.772,69	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.859.772,69
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.859.772,69	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.859.772,69
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.859.772,69	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.859.772,69

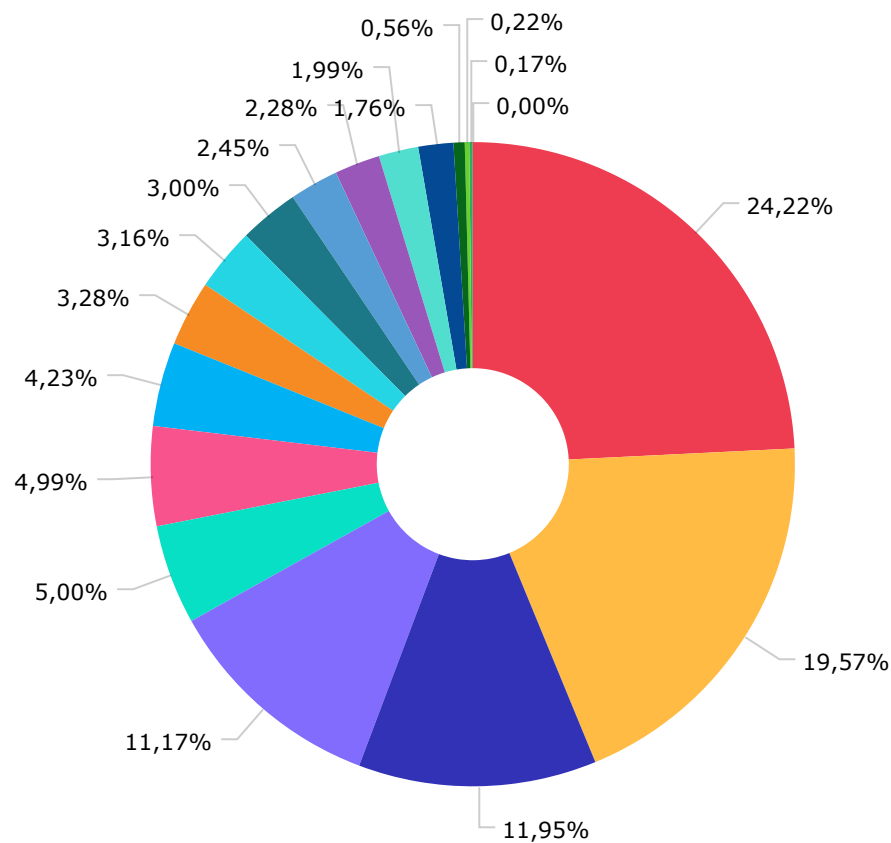
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33		
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,04	1,04	2,95	6,45	13,33	28,24	0,04	0,09
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,51	0,51	5,85	5,53	12,87	25,14	0,58	1,21
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95	0,95	2,78	5,94	12,79	27,22	0,02	0,04
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	4,78	4,78	14,72	12,57	26,83	5,62		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,56	4,56	14,15	11,69	25,21	3,42	5,69	11,99
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,87	4,87	12,52	12,80	14,00	-0,33	5,55	11,68
IBOVESPA - BENCHMARK	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92		
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	-4,83	-4,83	12,97	4,83	12,69	13,98	5,50	11,59
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-3,43	-3,43	13,39	1,79	11,23	13,48	6,30	13,28
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-4,56	-4,56	12,95	4,14	10,74	10,15	5,69	11,97
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-4,24	-4,24	12,76	3,09	10,49	5,13	5,52	11,63
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,15	-4,15	11,76	0,85	8,47	4,31	6,58	13,86
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-3,98	-3,98	13,06	0,35	7,93	2,31	6,44	13,57
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,37	-3,37	13,39	1,81	6,94	1,60	7,28	15,34
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-2,29	-2,29	18,75	7,82	6,33	13,01	5,84	12,29
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-4,28	-4,28	12,83	-0,62	3,61	8,07	5,54	11,67
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-6,19	-6,19	10,44	-7,26	-3,33	-13,15	7,57	15,95
IDIV - BENCHMARK	-3,51	-3,51	14,18	8,88	15,58	28,28		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,54	-3,54	13,62	8,29	14,09	25,29	4,60	9,68
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,81	0,81	4,15	4,81	11,43	23,53		
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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B - BENCHMARK	-0,45	-0,45	4,97	2,91	15,53	23,80		
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
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
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,51	-0,51	4,97	3,04	15,08	23,56	1,29	2,73
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,68	0,68	3,99	4,44	11,33	23,79		
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
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-1,47	-1,47	5,89	1,54	19,03	23,38		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,50	-1,50	5,81	1,37	18,64	22,54	2,04	4,29
IPCA - BENCHMARK	0,42	0,42	1,27	2,01	4,51	10,54		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,48	0,48	4,75	4,60	15,81	24,85	0,65	1,36
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85	0,85	2,92	5,79	15,22	26,51	0,07	0,14
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,46	0,46	3,82	4,85	15,10	25,59	0,57	1,19
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,66	0,66	3,33	4,67	13,16	25,72	0,46	0,96
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55	0,55	4,88	3,78	12,92		0,82	1,73
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,32	0,32	3,88	4,74	12,69	23,89	0,63	1,32
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,83	0,83	2,77	5,92	12,95	27,12		
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
SELIC - BENCHMARK	0,97	0,97	2,80	6,04	12,87	27,33		
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,95	0,95	2,73	5,89	12,57	26,60	0,01	0,02
MSCI WORLD - BENCHMARK	3,48	3,48	13,39	9,28	11,80	-3,12		

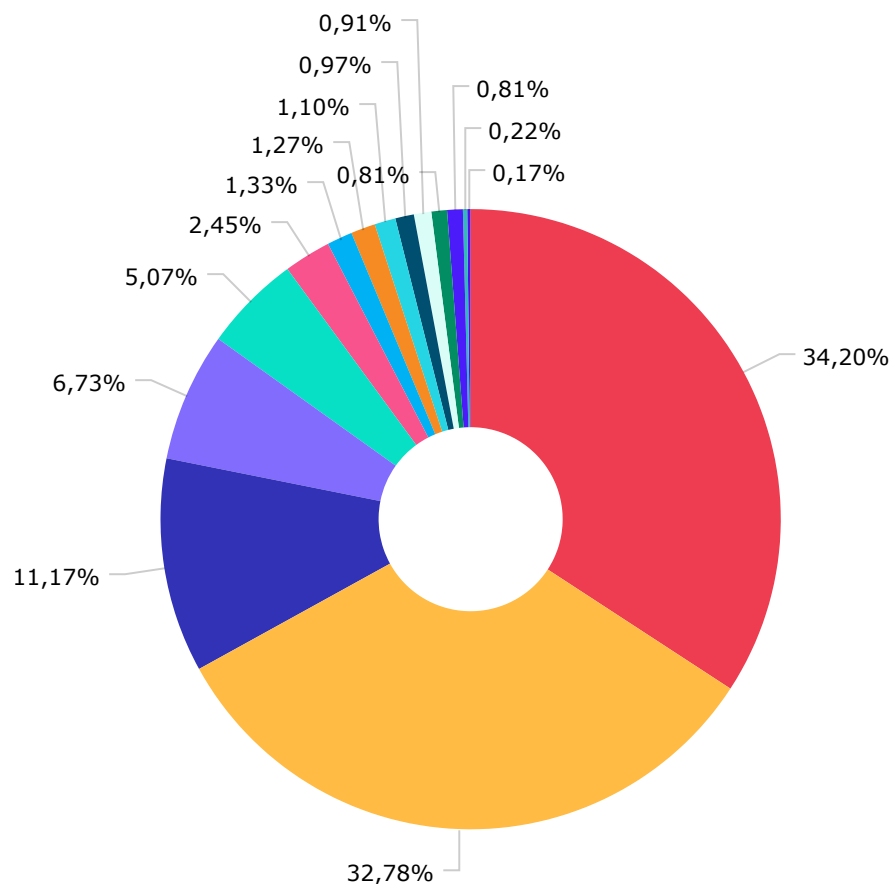
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	4,04	4,04	21,71	13,90	29,36	-4,31	9,69	20,41
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	2,81	2,81	12,59	8,12	4,44	-7,00	5,53	11,65
MSCI ACWI - BENCHMARK	2,86	2,86	12,43	7,98	9,50	-5,80		
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1,69	1,69	16,97	8,77	27,16	25,92	5,15	10,86
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2,79	2,79	16,40	9,90	13,12	0,70	6,09	12,83



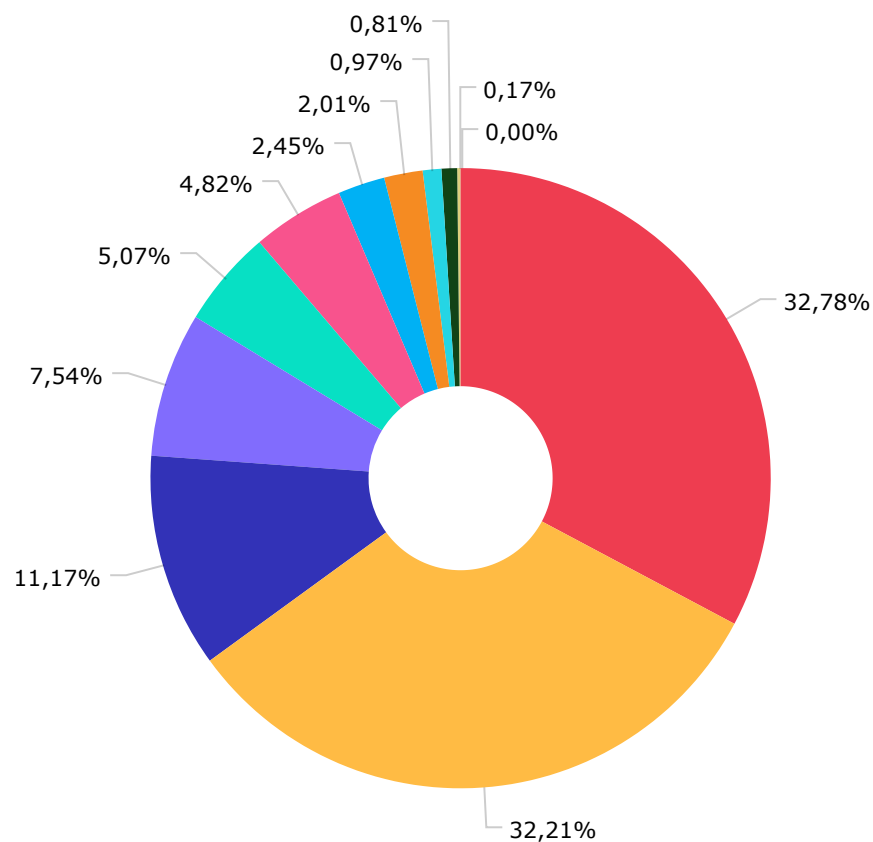
IPCA	17.931.219,58
IMA-B	17.697.504,64
Ibovespa	15.265.545,07
IMA-B 5+	12.750.806,09
Títulos Públicos	10.857.740,67
MSCI ACWI	6.096.781,58
Selic	4.851.588,49
Global BDRX	3.121.193,08
IDIV	2.216.286,03
MSCI WORLD	1.953.156,42
IMA-B 5	1.701.744,89
IRF-M 1	1.246.283,10
IDKA IPCA 2 Anos	754.420,60
CDI	581.541,66
Disponibilidades Financeiras	169.641,98



Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	23.541.021,28
Renda Fixa Indexados	19.018.624,21
Ações Livre	11.613.426,72
Títulos Públicos	10.857.740,67
Multimercados Livre	4.858.096,73
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	4.851.588,49
Renda Fixa Duração Livre Soberano	4.106.870,84
Ações Investimento no Exterior	3.191.841,27
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	3.071.128,70
Ações Indexados	2.911.139,50
Renda Fixa Duração Alta Soberano	2.381.329,02
Ações Dividendos	2.216.286,03
Ações Índice Ativo	1.935.710,37
Ações Sustentabilidade/Governança	1.708.430,91
Multimercados Macro	543.511,08
Ações Valor/Crescimento	218.030,65
Disponibilidades Financeiras	169.641,98
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	1.035,43



BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN...	33.239.459,64
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.859.873,09
TESOURO NACIONAL	10.857.740,67
ITAU UNIBANCO S.A.	6.536.773,37
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	4.923.531,16
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S....	2.381.329,02
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	1.291.929,60
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.238.684,85
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT B...	1.069.478,11
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	943.011,67
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT...	883.678,31
ITAÚ DTVM S.A.	791.474,08
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	790.817,68
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GEST...	218.030,65
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	169.641,98



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.859.873,09
BANCO BRADESCO S.A.	31.303.749,27
TESOURO NACIONAL	10.857.740,67
ITAU UNIBANCO S.A.	7.328.247,45
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	4.923.531,16
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	4.684.355,47
S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA...	2.381.329,02
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	1.953.156,42
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	943.011,67
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	789.782,25
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	169.641,98
SANTANDER DISTRIBUIDORA DE TIT...	1.035,43

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	95.999.136,54	1.530.719,12	81.000,00	97.025.811,90	-423.043,76	-423.043,76	-0,43% ▼	-0,43%	0,85%	0,85%	-50,59%	2,35%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

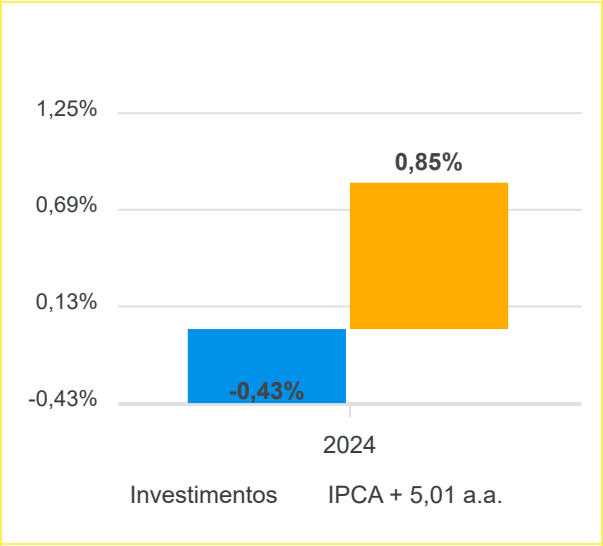
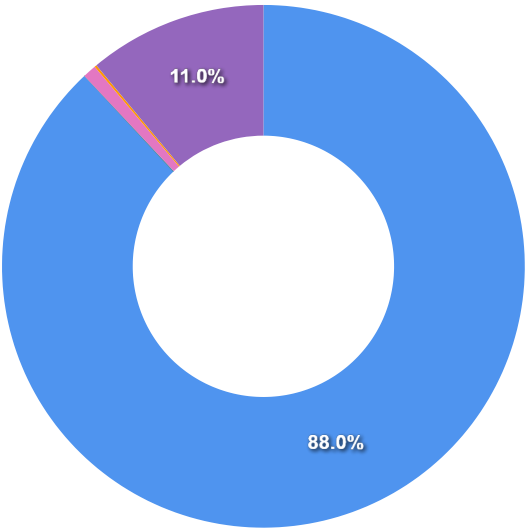


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 31/01/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	85.522.554,40	88,14
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	815.158,81	0,84
Até D+3600	131.880,49	0,14
Acima D+3600	10.725.860,18	11,05
Indeterminado	0,00	0,00



RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	10.756.106,26	0,00	0,00	10.857.740,67	101.634,41	0,94% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	531.291,18	1.300.000,00	0,00	1.845.291,74	14.000,56	0,76% ▲	0,07%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	557.334,31	0,00	0,00	554.649,70	-2.684,61	-0,48% ▼	1,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	810.695,87	0,00	0,00	815.158,81	4.462,94	0,55% ▲	0,82%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.393.513,10	0,00	0,00	2.381.329,02	-12.184,08	-0,51% ▼	1,29%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.741.249,27	0,00	0,00	10.790.215,19	48.965,92	0,46% ▲	0,57%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.656.979,03	150.000,00	0,00	4.851.588,49	44.609,46	0,93% ▲	0,01%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.944.445,43	0,00	0,00	12.750.806,09	-193.639,34	-1,50% ▼	2,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	615.610,19	0,00	0,00	619.642,89	4.032,70	0,66% ▲	0,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	748.957,24	0,00	0,00	754.420,60	5.463,36	0,73% ▲	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.690.521,76	0,00	0,00	1.701.744,89	11.223,13	0,66% ▲	0,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.508.181,04	0,00	0,00	13.445.333,63	-62.847,41	-0,47% ▼	1,27%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.235.021,19	0,00	0,00	1.246.283,10	11.261,91	0,91% ▲	0,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.646,84	0,00	0,00	36.995,15	348,31	0,95% ▲	0,02%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.322.669,02	0,00	0,00	1.316.192,29	-6.476,73	-0,49% ▼	1,31%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.056.593,94	0,00	0,00	3.071.128,70	14.534,76	0,48% ▲	0,65%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	787.259,85	0,00	0,00	789.782,25	2.522,40	0,32% ▲	0,63%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.152,02	80.719,12	81.000,00	1.035,43	164,29	0,20% ▲	0,04%
	66.394.227,54	1.530.719,12	81.000,00	67.829.338,64	-14.608,02	-0,02%	0,88%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.790.038,64	0,00	0,00	1.708.430,91	-81.607,73	-4,56% ▼	5,69%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	3.058.765,51	0,00	0,00	2.911.139,50	-147.626,01	-4,83% ▼	5,50%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	2.022.342,55	0,00	0,00	1.935.710,37	-86.632,18	-4,28% ▼	5,54%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	975.885,55	0,00	0,00	943.011,67	-32.873,88	-3,37% ▼	7,28%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.540.661,39	0,00	0,00	3.393.790,36	-146.871,03	-4,15% ▼	6,58%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.297.559,45	0,00	0,00	2.216.286,03	-81.273,42	-3,54% ▼	4,60%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.337.794,68	0,00	0,00	1.291.929,60	-45.865,08	-3,43% ▼	6,30%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.754.048,25	0,00	0,00	1.713.948,27	-40.099,98	-2,29% ▼	5,84%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	824.291,46	0,00	0,00	791.474,08	-32.817,38	-3,98% ▼	6,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	381.702,12	0,00	0,00	358.079,66	-23.622,46	-6,19% ▼	7,57%
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	227.676,43	0,00	0,00	218.030,65	-9.645,78	-4,24% ▼	5,52%
-	18.210.766,03	0,00	0,00	17.481.831,10	-728.934,93	-4,00%	5,89%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	540.745,39	0,00	0,00	543.511,08	2.765,69	0,51% ▲	0,58%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.777.579,44	0,00	0,00	4.858.096,73	80.517,29	1,69% ▲	5,15%
-	5.318.324,83	0,00	0,00	5.401.607,81	83.282,98	1,57%	4,69%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1.040.285,64	0,00	0,00	1.069.478,11	29.192,47	2,81% ▲	5,53%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.652.221,17	0,00	0,00	1.727.576,34	75.355,17	4,56% ▲	5,69%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.328.935,25	0,00	0,00	1.393.616,74	64.681,49	4,87% ▲	5,55%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	849.355,91	0,00	0,00	883.678,31	34.322,40	4,04% ▲	9,69%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.205.020,17	0,00	0,00	1.238.684,85	33.664,68	2,79% ▲	6,09%
	6.075.818,14	0,00	0,00	6.313.034,35	237.216,21	3,90%	5,08%

Cenário Econômico

O primeiro mês do ano começou amargo para a maioria das carteiras de investimentos. Após um bom retorno no ano de 2023, o retorno do primeiro mês do ano de 2024, dificilmente superará a meta. Os ativos ligados a renda fixa, fecharam com sinais mistos, com o CDI e Títulos Públicos levados ao vencimento com resultados positivos e os fundos atrelados a inflação com desempenho negativo. Já na renda variável o desempenho foi em sentido único, todos os ativos fecharam em forte baixa com maiores incertezas no mercado. Já os ativos no exterior fecharam no positivo principalmente pelo desempenho do dólar frente ao real no mês de janeiro e as valorizações históricas de alta dos principais índices do mercado acionário americano.

Análise da Carteira de Investimentos

Carteira de Investimentos

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2024. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2024 ainda não foram atingidos diante das oportunidades que o mercado ofereceu como boas alternativas.

Rentabilidade e Risco (por ativo)

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados.

Distribuição por Benchmarks

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos da política de investimentos, e de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Distribuição por Classificação ANBIMA

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

Distribuição por Gestoras e Administradoras

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização, estão presentes na lista exaustiva da SPREV, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

No segmento de renda fixa, os ativos fecharam com sinais mistos, com o CDI e Títulos Públicos levados ao vencimento com resultados positivos e os fundos atrelados a inflação com desempenho negativo. Já na renda variável o desempenho não foi satisfatório devido as incertezas em relação ao novo ano no mercado. Já os ativos no exterior fecharam no positivo principalmente pelo desempenho do dólar frente ao real no mês de janeiro e as valorizações históricas de alta dos principais índices do mercado acionário americano.

Retorno dos Fundos de Investimentos

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2024, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 15 de fevereiro de 2024.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

