

2024

Relatório Mensal

Abril

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	198.172.849,99	34,63%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.966.396,71	5,93%	6.756.075.412,20	0,50%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.491.669,52	2,88%	5.183.551.580,62	0,32%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	64.740.141,51	11,31%	8.588.764.215,21	0,75%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.110.783,47	2,64%	2.247.094.886,70	0,67%	7º I b
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	76.258.035,33	13,32%	15.720.644.238,34	0,49%	7º III a
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	26.136.584,26	4,57%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	27.277.331,28	4,77%	0,00		7º IV
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	37.127.562,73	6,49%	0,00		7º IV
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	21.422.096,47	3,74%	0,00		7º IV
BB AGRO FIC AÇÕES	12.666.346,12	2,21%	228.808.024,56	5,54%	8º I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	12.885.326,07	2,25%	1.197.610.494,30	1,08%	8º I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.958.310,82	0,34%	433.331.548,35	0,45%	8º I
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.053.926,37	1,93%	1.401.576.586,91	0,79%	9º III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.956.347,39	1,74%	697.836.710,76	1,43%	9º III
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	7.095.681,72	1,24%	71.830.833,46	9,88%	10º I

Investimentos

\$ 572.319.389,76

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 572.319.389,76

Governança (Pró Gestão)



Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2040 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	5.000	4.387,32007	21.936.600,35
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	3.000	4.347,22829	13.041.684,87
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,0950%	2.000	4.347,22829	8.694.456,58
NTN-B - 15/05/2045 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	1.000	4.433,698165	4.433.698,17
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	14/09/2022	Curva - Taxa: 5,9000%	2.672	4.387,447927	11.723.260,86
NTN-B - 15/08/2050 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7650%	7.828	4.464,11541	34.945.095,43
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/04/2022	A mercado	1.174	4.275,031550	5.018.887,04
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	10/08/2022	Curva - Taxa: 5,9200%	2.000	4.444,732248	8.889.464,50
NTN-B - 15/05/2055 - PREVIDENCIÁRIO	11/11/2022	Curva - Taxa: 6,0100%	8.326	4.391,53936	36.563.956,71
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	04/05/2022	Curva - Taxa: 5,8501%	46	4.428,48585	203.710,35
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	06/05/2022	Curva - Taxa: 5,7699%	4.500	4.480,302141	20.161.359,63
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 5,8625%	5.000	4.420,562961	22.102.814,80
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	07/07/2022	Curva - Taxa: 6,1450%	2.300	4.246,280711	9.766.445,64
NTN-B - 15/08/2060 - PREVIDENCIÁRIO	19/10/2022	Curva - Taxa: 5,7555%	154	4.489,708175	691.415,06

Investimentos

\$ 572.319.389,76

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 572.319.389,76

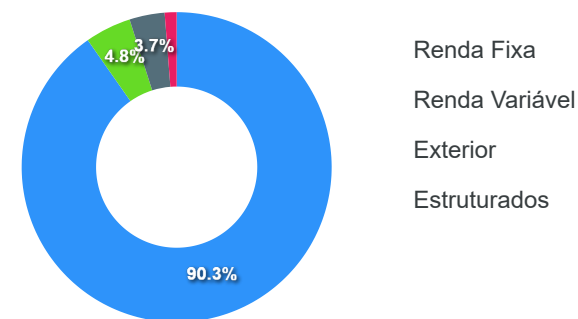
Governança (Pró Gestão)


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7° I a - Títulos TN SELIC	100,00%	34,63% 198.172.849,99	65,37% 374.146.539,77
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	22,77% 130.308.991,21	77,23% 442.010.398,55
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	13,32% 76.258.035,33	46,68% 267.133.598,53
7° IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	19,56% 111.963.574,74	0,44% 2.500.303,21
8° I - Fundos de Ações	30,00%	4,81% 27.509.983,01	25,19% 144.185.833,92
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,67% 21.010.273,76	6,33% 36.221.665,22
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	1,24% 7.095.681,72	8,76% 50.136.257,26

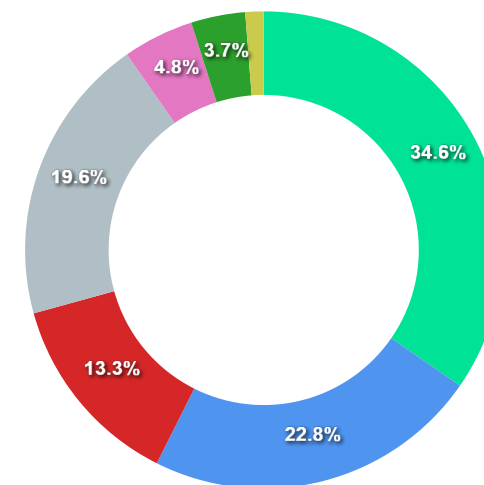
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos

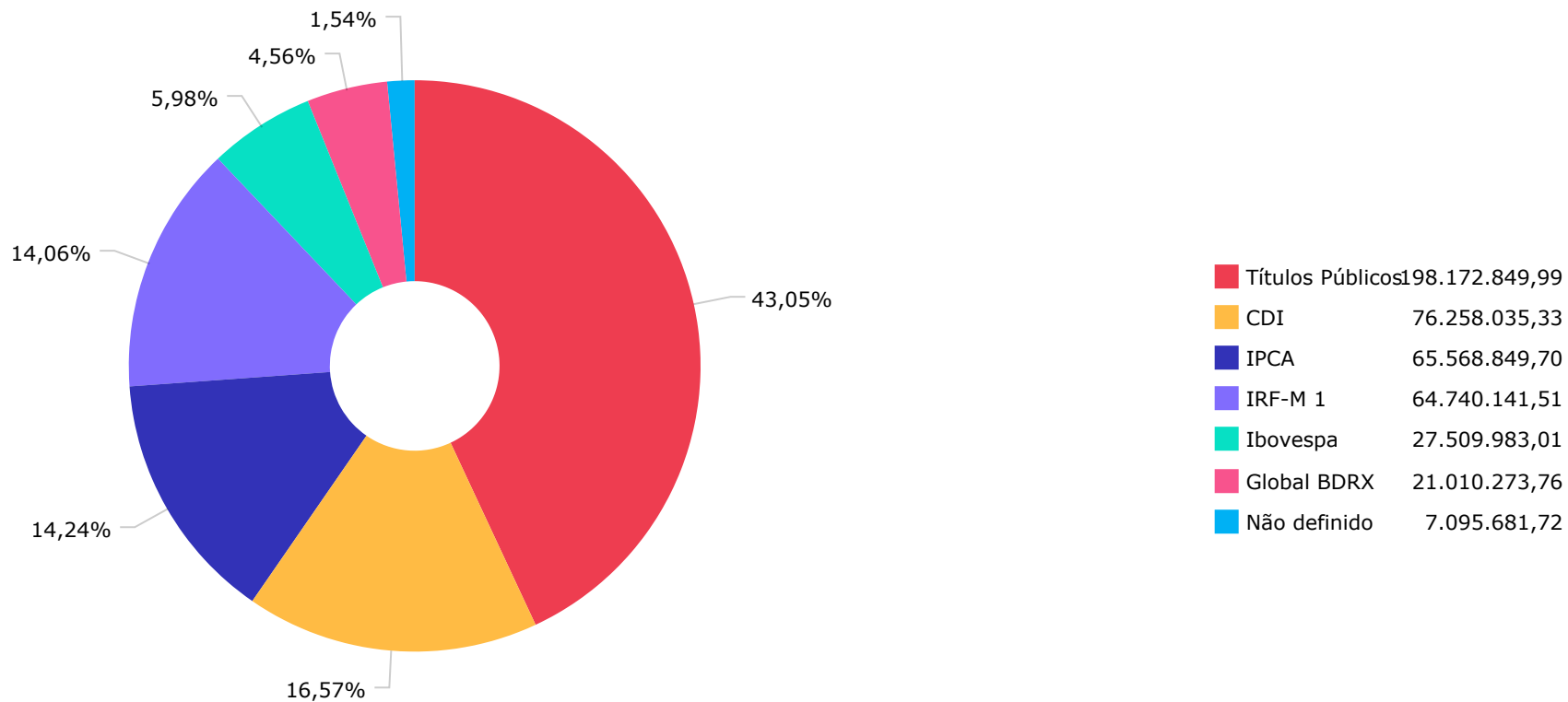


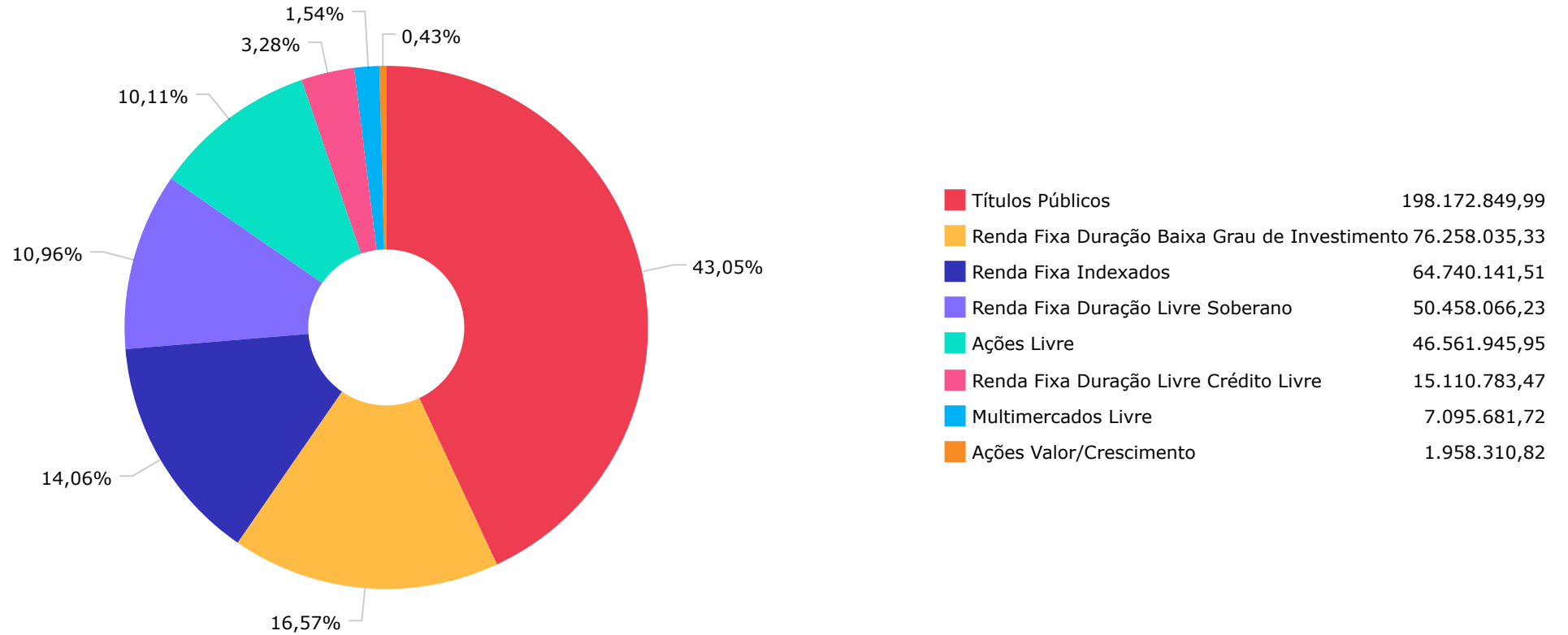
Artigos

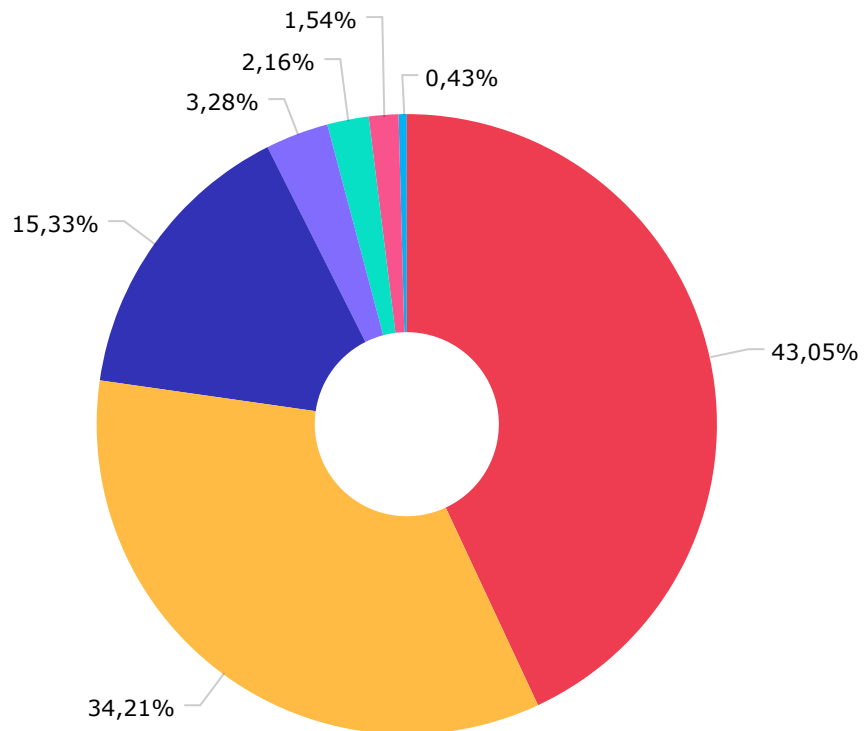


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	34,63%	0,00%	36,00%	100,00%	374.146.539,77	8° I - Fundos de Ações	4,81%	0,00%	6,00%	30,00%	144.185.833,92
7° I b - FI 100% Títulos TN	22,77%	0,00%	14,00%	100,00%	442.010.398,55	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	6,00%	30,00%	171.695.816,93
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	572.319.389,76	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	57.231.938,98
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.615.969,49	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	57.231.938,98
7° III a - FI Referenciados RF	13,32%	0,00%	15,00%	60,00%	267.133.598,53	9° III - Ações - BDR Nível I	3,67%	0,00%	2,00%	10,00%	36.221.665,22
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	343.391.633,86	10° I - Fundos Multimercados	1,24%	0,00%	1,00%	10,00%	50.136.257,26
7° IV - Ativos Financeiros de ...	19,56%	0,00%	14,00%	20,00%	2.500.303,21	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.615.969,49
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	28.615.969,49						
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	28.615.969,49						
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	28.615.969,49						

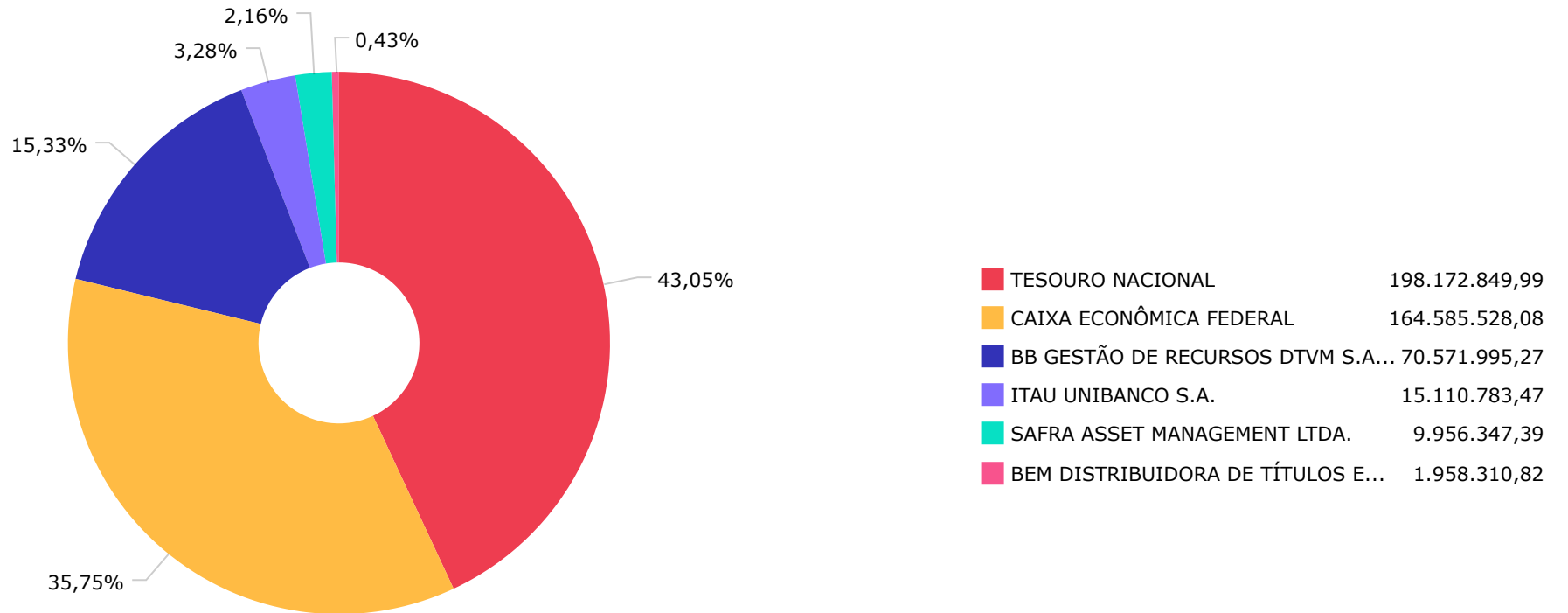
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	0,36	2,73	1,68	2,32	7,68	25,35	0,53	1,11
CDI - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,89	3,64	2,61	5,61	12,90	28,00	0,02	0,04
GLOBAL BDRX - BENCHMARK								
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,04	11,60	6,96	22,02	27,73	29,97	9,59	20,19
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,70	9,53	6,62	19,28	21,64	23,83	6,86	14,45
IBOVESPA - BENCHMARK								
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-4,88	-6,05	-0,70	12,17	23,66	18,92	6,34	13,35
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,92	-10,15	-3,95	5,39	14,12	3,41	6,11	12,87
BB AGRO FIC AÇÕES	-5,34	-7,30	-2,25	5,97	10,94	-2,33	7,67	16,16
IPCA - BENCHMARK								
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,28	2,70	1,84	4,81	12,62	25,48	0,47	0,98
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,23	1,36	0,88	5,67	11,40	22,40	1,09	2,30
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,32	1,47	0,81	4,17	10,67	23,58	0,89	1,88
IRF-M 1 - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,58	3,07	2,14	5,00	11,80	26,43	0,32	0,68







TESOURO NACIONAL	198.172.849,99
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	157.489.846,36
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	70.571.995,27
ITAU UNIBANCO S.A.	15.110.783,47
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	9.956.347,39
CAIXA DTVM	7.095.681,72
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	1.958.310,82



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	555.471.939,62	3.459.435,67	6.976.737,86	555.888.364,94	3.933.727,51	3.933.727,51	0,71% ▲	0,71%	0,84%	0,84%	84,52%	0,61%
Fevereiro	555.888.364,94	13.121.177,93	9.022.822,62	565.782.661,55	5.795.941,30	9.729.668,81	1,04% ▲	1,75%	1,20%	2,05%	85,37%	0,71%
Março	565.782.661,55	29.232.887,35	30.527.818,89	570.083.126,57	5.595.396,56	15.325.065,37	0,99% ▲	2,76%	0,54%	2,60%	106,15%	0,54%
Abril	570.083.126,57	4.342.199,84	3.640.748,99	572.319.389,76	1.534.812,34	16.859.877,71	0,27% ▲	3,03%	0,80%	3,42%	88,60%	0,76%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	15.325.065,37	2,76%	2,60%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

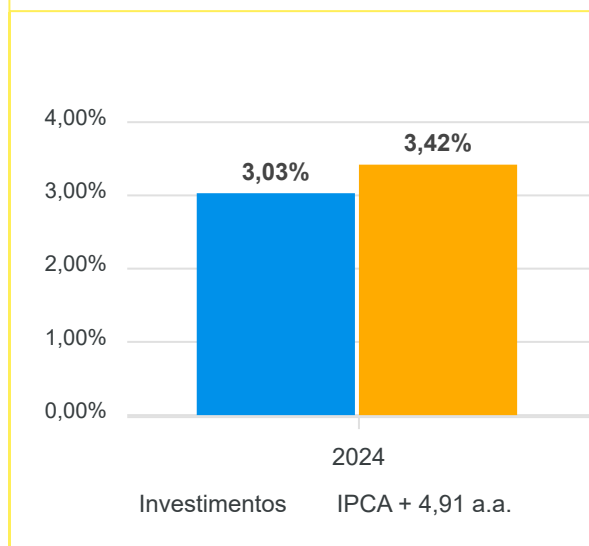


Gráfico Risco x Retorno

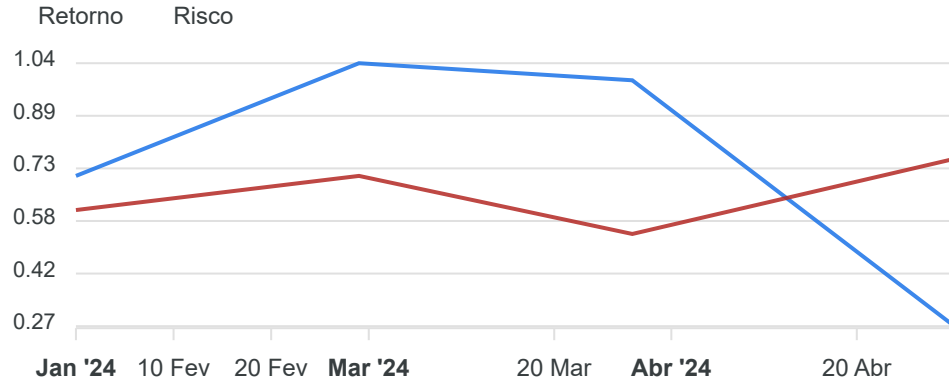
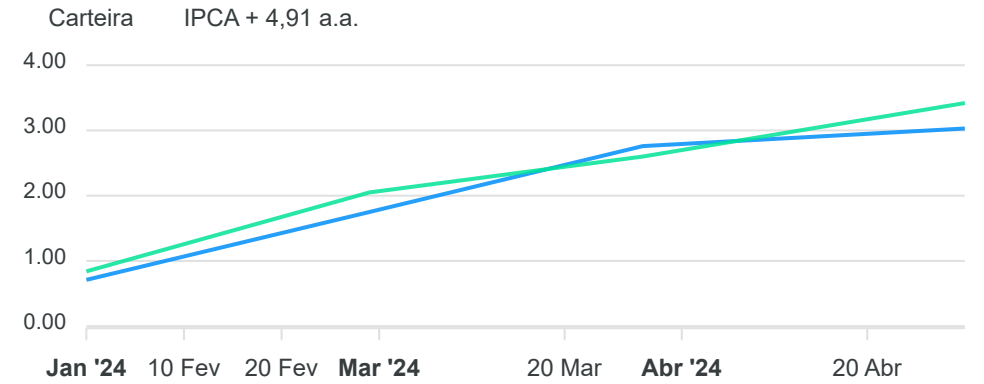
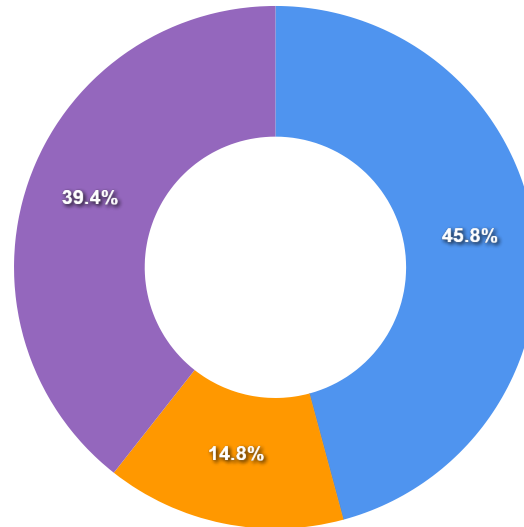


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/04/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	262.182.965,03	45,81
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	84.686.243,46	14,80
Acima D+3600	225.450.181,27	39,39
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	196.950.307,22	0,00	0,00	198.172.849,99	1.222.542,77	0,62% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.869.891,27	0,00	0,00	33.966.396,71	96.505,44	0,28% ▲	0,47%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	74.855.560,64	4.342.199,84	3.640.748,99	76.258.035,33	701.023,84	0,89% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.544.714,21	0,00	0,00	16.491.669,52	-53.044,69	-0,32% ▼	0,89%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	64.363.921,30	0,00	0,00	64.740.141,51	376.220,21	0,58% ▲	0,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.146.021,04	0,00	0,00	15.110.783,47	-35.237,57	-0,23% ▼	1,09%
LF BANCO MASTER 15/12/2031 IPCA + 6,50%	25.972.997,34	0,00	0,00	26.136.584,26	163.586,92	0,63% ▲	-
LF BANCO MASTER 20/03/2034 IPCA + 7,00%	27.106.912,00	0,00	0,00	27.277.331,28	170.419,28	0,63% ▲	-
LF BANCO MASTER 26/10/2031 IPCA + 7,00%	36.910.023,07	0,00	0,00	37.127.562,73	217.539,66	0,59% ▲	-
LF DAYCOVAL 25/08/2031 IPCA + 5,89%	21.269.321,05	0,00	0,00	21.422.096,47	152.775,42	0,72% ▲	-
	512.989.669,14	4.342.199,84	3.640.748,99	516.703.451,27	3.012.331,28	0,59%	0,17%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AGRO FIC AÇÕES	13.380.805,38	0,00	0,00	12.666.346,12	-714.459,26	-5,34% ▼	7,67%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	13.272.949,69	0,00	0,00	12.885.326,07	-387.623,62	-2,92% ▼	6,11%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.058.757,03	0,00	0,00	1.958.310,82	-100.446,21	-4,88% ▼	6,34%
-	28.712.512,10	0,00	0,00	27.509.983,01	-1.202.529,09	-4,19%	6,84%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	7.070.052,50	0,00	0,00	7.095.681,72	25.629,22	0,36% ▲	0,53%
-	7.070.052,50	0,00	0,00	7.095.681,72	25.629,22	0,36%	0,53%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.284.658,17	0,00	0,00	11.053.926,37	-230.731,80	-2,04% ▼	9,59%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.026.234,66	0,00	0,00	9.956.347,39	-69.887,27	-0,70% ▼	6,86%
	21.310.892,83	0,00	0,00	21.010.273,76	-300.619,07	-1,41%	5,05%

