

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
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.833.216,53	2,41%	6.413.203.187,61	0,15%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.737.561,47	2,14%	5.834.557.206,92	0,15%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.467.830,54	0,36%	5.251.127.483,30	0,03%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.069.158,04	5,16%	7.961.364.534,06	0,26%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	899.537,84	0,22%	4.127.932.079,70	0,02%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.375.117,01	5,23%	2.636.302.220,38	0,81%	7º I b
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.797.402,64	2,89%	778.401.797,00	1,52%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.970.403,80	2,69%	1.871.533.642,91	0,59%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.646.637,78	0,40%	5.336.453.186,66	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.845.983,81	7,55%	5.245.527.378,78	0,59%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	64.098.654,09	15,69%	7.718.818.121,25	0,83%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.441.525,22	1,82%	1.446.793.477,31	0,51%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	519.152,35	0,13%	5.008.664.499,36	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.235.964,22	0,79%	641.038.306,49	0,50%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	72.481.844,38	17,74%	8.572.761.910,40	0,85%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	72.625,94	0,02%	1.608.068.056,62	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	22.826.804,65	5,59%	2.310.441.680,03	0,99%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.649.077,23	1,63%	499.198.947,25	1,33%	7º I b
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	776.153,98	0,19%	936.745.684,71	0,08%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	42.185.923,00	10,33%	16.400.080.186,89	0,26%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	493.522,91	0,12%	896.178.545,03	0,06%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	32.560.283,17	7,97%	9.205.921.475,18	0,35%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.017.327,62	0,25%	1.285.884.378,15	0,08%	7º III a
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1.623.950,03	0,40%	306.013.096,03	0,53%	7º III a
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.679.171,20	1,88%	223.792.524,56	3,43%	7º V b
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	583.350,48	0,14%	220.830.836,26	0,26%	8º I
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	643.023,72	0,16%	274.908.170,14	0,23%	8º I

Investimentos

\$ 408.521.698,89

Disponibilidades Financeiras

\$ 84.038,23

Total Carteira

\$ 408.605.737,12

Governança (Pró Gestão)


Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	618.233,49	0,15%	312.219.410,42	0,20%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.063.072,51	0,99%	485.677.409,40	0,84%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.728.955,19	2,14%	2.108.221.544,73	0,41%	9º III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	443.515,80	0,11%	102.760.776,84	0,43%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	10.845.079,74	2,65%	1.236.053.176,54	0,88%	10º I
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	291.638,51	0,07%	126.820.094,69	0,23%	10º I

Investimentos

\$ 408.521.698,89

Disponibilidades Financeiras

\$ 84.038,23

Total Carteira

\$ 408.605.737,12

Governança (Pró Gestão)

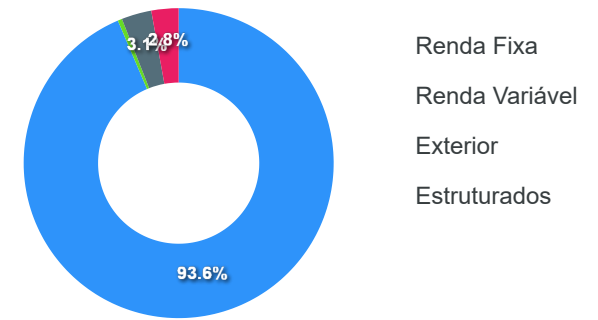
☞

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	72,43% 295.968.497,54	27,57% 112.637.239,58
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	19,25% 78.657.160,71	40,75% 166.506.281,56
7º V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	1,88% 7.679.171,20	3,12% 12.751.115,66
8º I - Fundos de Ações	30,00%	0,45% 1.844.607,69	29,55% 120.737.113,45
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,13% 12.792.027,70	6,87% 28.068.546,01
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	2,83% 11.580.234,05	7,17% 29.280.339,66

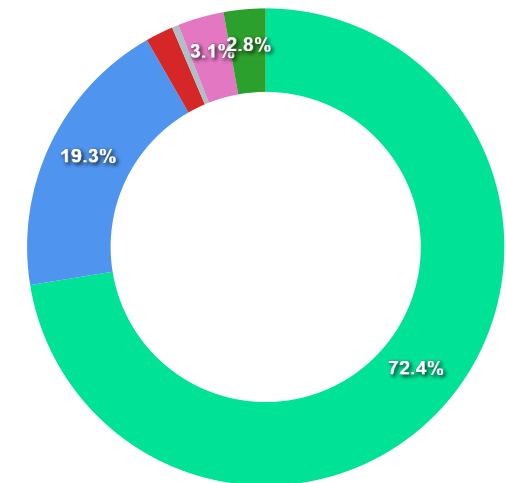
Governança (Pró Gestão)

Não possui

Segmentos



Artigos

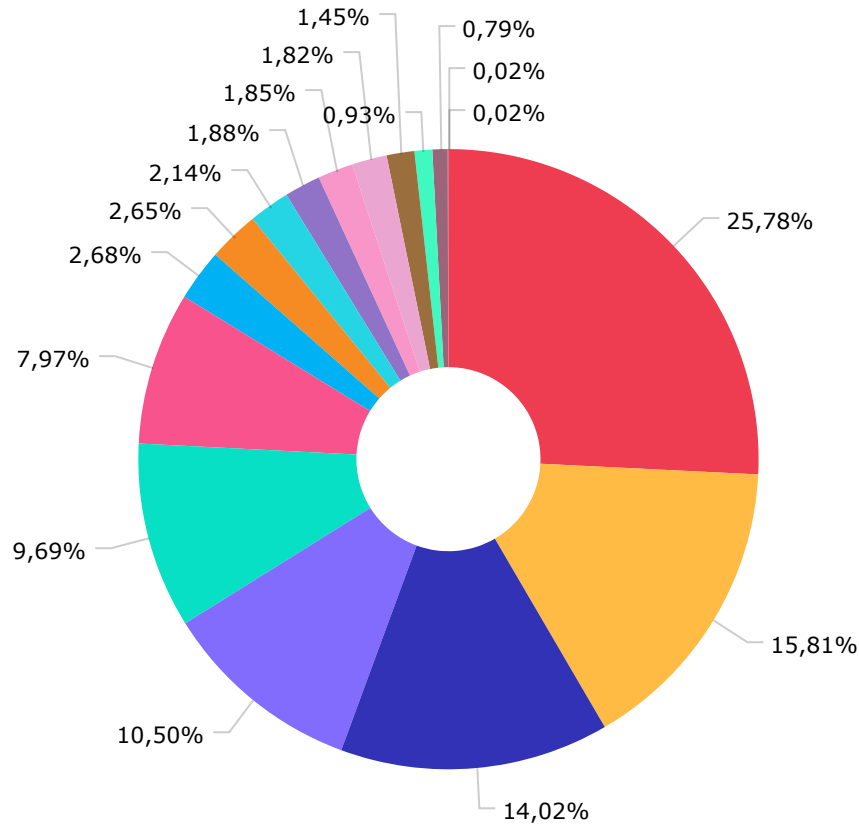


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	21,00%	100,00%	408.605.737,12	8° I - Fundos de Ações	0,45%	0,00%	6,00%	30,00%	120.737.113,45
7° I b - FI 100% Títulos TN	72,43%	0,00%	44,00%	100,00%	112.637.239,58	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	122.581.721,14
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	408.605.737,12	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	40.860.573,71
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.430.286,86	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	40.860.573,71
7° III a - FI Referenciados RF	19,25%	0,00%	21,00%	60,00%	166.506.281,56	9° III - Ações - BDR Nível I	3,13%	0,00%	2,00%	10,00%	28.068.546,01
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	245.163.442,27	10° I - Fundos Multimercados	2,83%	0,00%	2,00%	10,00%	29.280.339,66
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	81.721.147,42	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.430.286,86
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.430.286,86	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.430.286,86
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	1,88%	0,00%	2,00%	5,00%	12.751.115,66	11° - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.430.286,86
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.430.286,86	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.430.286,86

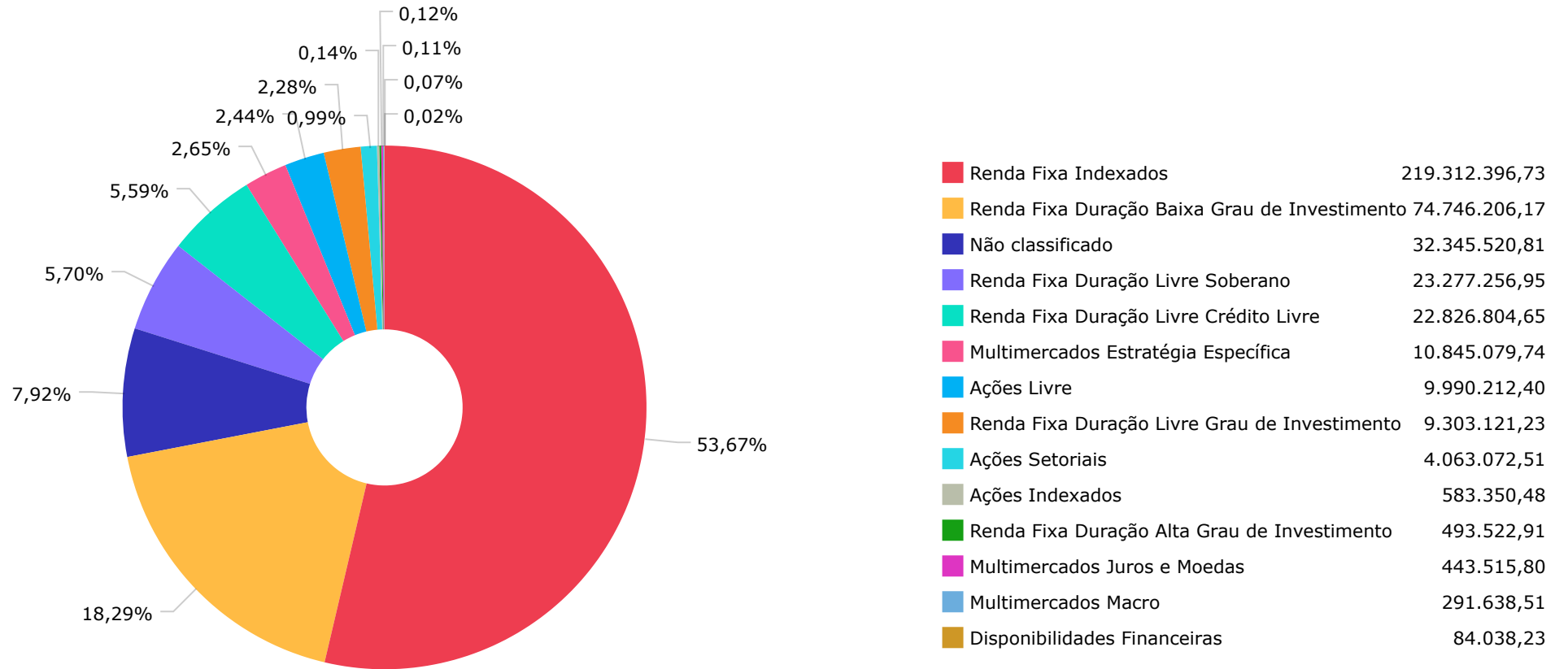
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33		
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,94	0,94	2,91	6,00	13,08	27,82	0,13	0,27
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97	0,97	2,81	6,04	12,80	27,43	0,01	0,02
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,43	-0,43	2,94	2,45	8,94	18,57	1,24	2,62
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
IBOVESPA - BENCHMARK	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92		
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,80	3,80	18,95	15,19	40,84	15,82	7,33	15,44
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	-2,10	-2,10	15,57	8,88	19,40	29,66	5,77	12,16
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,67	-1,67	16,23	8,33	18,52	32,98	5,18	10,92
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	-4,89	-4,89	12,57	4,16	11,32	11,14	5,48	11,54
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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71	0,71	3,96	4,60	10,93	23,00	0,57	1,19
IMA GERAL - BENCHMARK	0,47	0,47	3,98	5,14	14,53	26,21		
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,45	0,45	3,95	5,01	14,44	26,03	0,58	1,21
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 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,49	-0,49	4,89	2,70	15,25	23,11	1,28	2,70
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

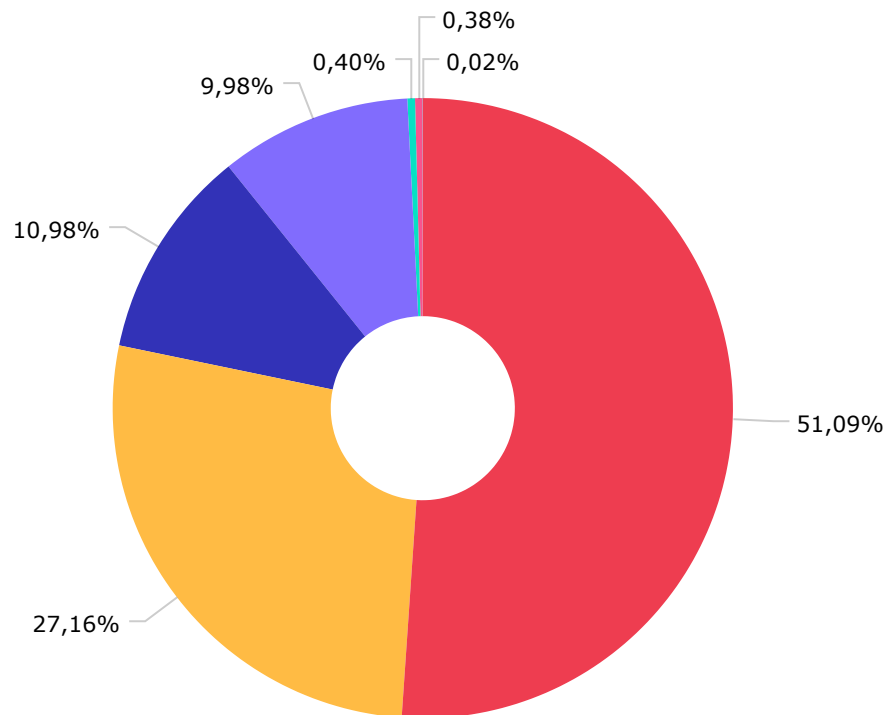
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,68	0,68	3,99	4,44	11,33	23,79		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,66	0,66	3,94	4,34	11,18	23,49	0,55	1,15
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,65	0,65	3,92	4,28	11,06	22,94	0,55	1,16
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-1,47	-1,47	5,89	1,54	19,03	23,38		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,46	-1,46	5,87	1,60	18,68	22,73	2,01	4,23
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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,66	0,66	3,33	4,67	13,16	25,72	0,46	0,96
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,18	0,18	4,80	3,96	12,59	20,18	1,05	2,22
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12	1,12	2,87	5,42			0,33	0,70
IRF-M - BENCHMARK	0,67	0,67	4,68	6,05	16,31	27,74		
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66	0,66	4,64	5,92	15,88	27,01	0,79	1,67
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,82	0,82	2,74	5,84	12,78	26,69	0,14	0,29
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
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87	0,87	2,76	5,84	12,75	26,62	0,11	0,24
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86	0,86	2,74	5,80	12,67	26,44	0,12	0,26
IRF-M 1+ - BENCHMARK	0,60	0,60	5,55	6,14	18,37	28,70		
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59	0,59	5,52	6,01	18,02	27,84	1,08	2,27
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	1,59	1,59	15,54	5,59	18,86	7,31		

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1,67	1,67	16,91	8,72	27,05	25,82	5,15	10,85
SELIC - BENCHMARK	0,97	0,97	2,80	6,04	12,87	27,33		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09	1,09	3,04	6,56	13,58	28,79	0,07	0,15
IPCA + 5,00% AO ANO - BENCHMARK	0,85	0,85	2,51	4,53	9,73	21,87		
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12	1,12	2,87	2,45			0,33	0,70
IPCA + 6,00% AO ANO - BENCHMARK	0,93	0,93	2,75	5,02	10,78	24,20		
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,67	0,67	4,05	4,77	11,78	24,69	0,55	1,15

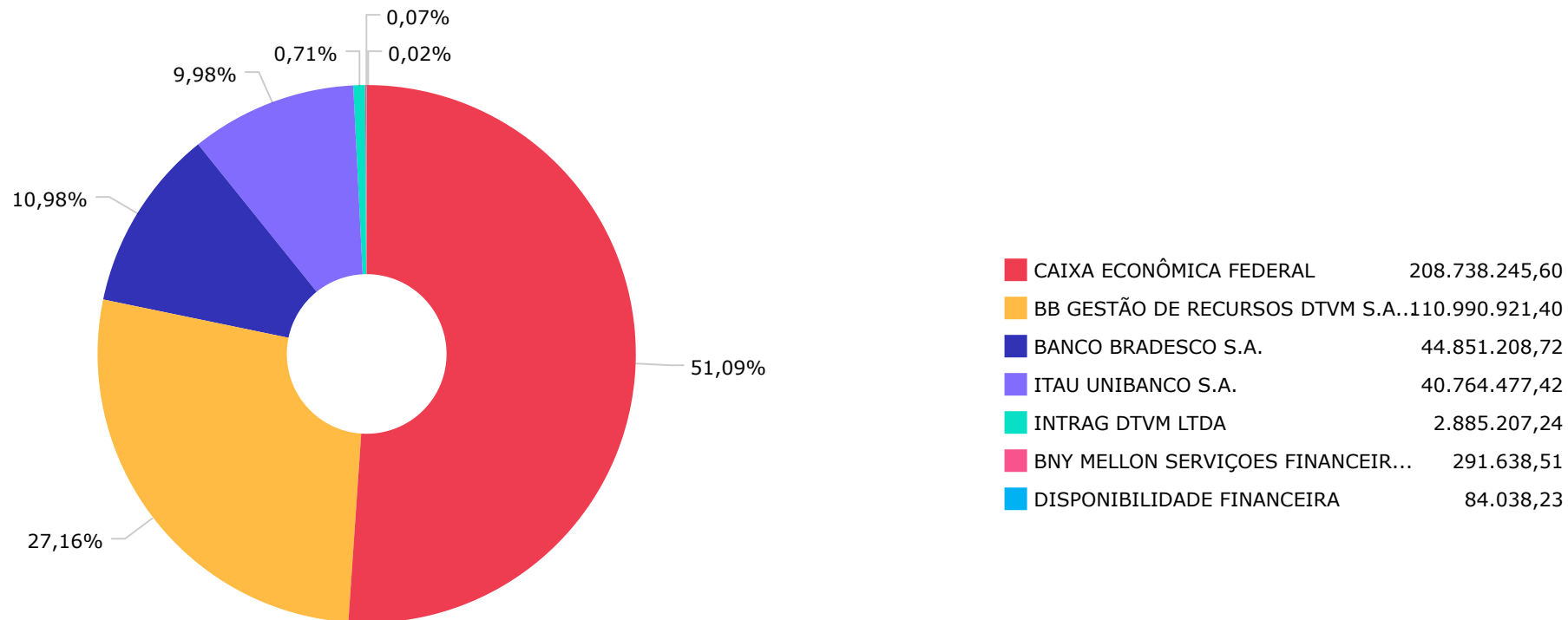


IRF-M 1	105.348.405,06
IMA-B 5	64.592.177,00
IPCA	57.305.726,00
CDI	42.921.077,31
IDKA IPCA 2 Anos	39.583.545,28
Selic	32.560.283,17
IPCA + 5,00% ao ano	10.970.403,80
S&P 500 (Moeda Original)	10.845.079,74
Global BDRX	8.728.955,19
IPCA + 6,00% ao ano	7.679.171,20
IRF-M	7.548.615,07
IMA-B 5+	7.441.525,22
Ibovespa	5.907.680,20
IMA-B	3.780.464,49
IMA Geral	3.235.964,22
Disponibilidades Financeiras	84.038,23
IRF-M 1+	72.625,94





CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	208.738.245,60
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	110.990.921,40
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	44.851.208,72
ITAU UNIBANCO S.A.	40.764.477,42
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA...	1.623.950,03
XP GESTAO DE RECURSOS LTDA	1.552.895,72
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	84.038,23



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	406.354.111,89	47.000,33	1.505.989,00	408.521.698,89	3.626.575,67	3.626.575,67	0,89% ▲	0,89%	0,85%	0,85%	104,71%	0,67%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

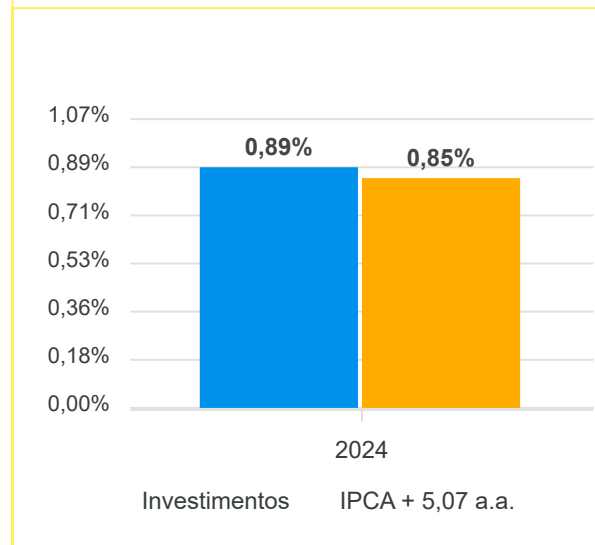
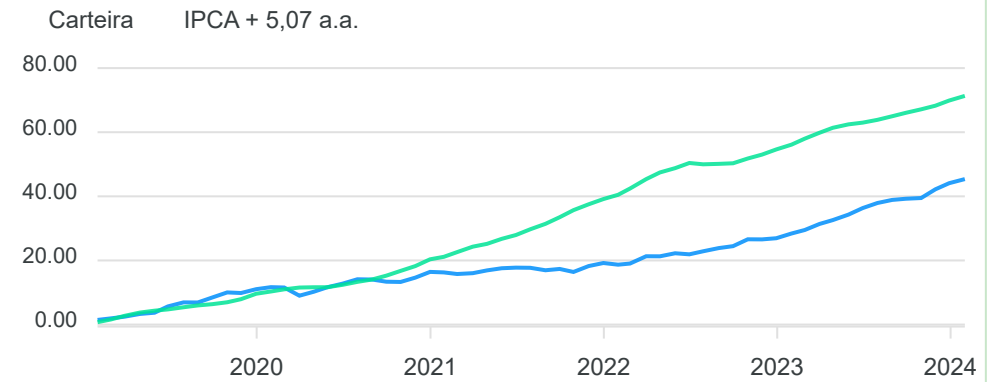


Gráfico Risco x Retorno

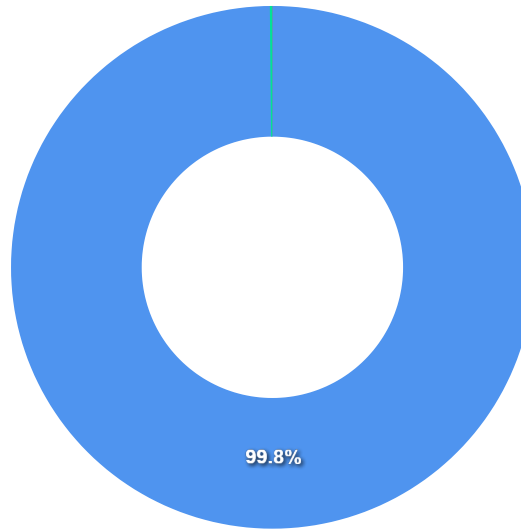


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/01/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	407.962.713,40	99,86
Até D+180	643.023,72	0,16
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	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.750.419,44	0,00	0,00	9.833.216,53	82.797,09	0,85% ▲	0,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.675.804,32	0,00	0,00	8.737.561,47	61.757,15	0,71% ▲	0,57%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	779.998,04	0,00	0,00	776.153,98	-3.844,06	-0,49% ▼	1,28%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.474.935,11	0,00	0,00	1.467.830,54	-7.104,57	-0,48% ▼	1,28%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.888.555,98	0,00	0,00	21.069.158,04	180.602,06	0,86% ▲	0,12%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	893.655,82	0,00	0,00	899.537,84	5.882,02	0,66% ▲	0,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	41.782.001,05	0,00	0,00	42.185.923,00	403.921,95	0,97% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.139.188,14	0,00	0,00	21.375.117,01	235.928,87	1,12% ▲	0,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	490.314,57	0,00	0,00	493.522,91	3.208,34	0,65% ▲	0,55%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.695.991,15	0,00	0,00	11.797.402,64	101.411,49	0,87% ▲	0,11%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	32.210.258,28	0,00	0,00	32.560.283,17	350.024,89	1,09% ▲	0,07%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.849.397,68	0,00	0,00	10.970.403,80	121.006,12	1,12% ▲	0,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.635.921,30	0,00	0,00	1.646.637,78	10.716,48	0,66% ▲	0,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.622.603,75	0,00	0,00	30.845.983,81	223.380,06	0,73% ▲	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	63.675.918,89	0,00	0,00	64.098.654,09	422.735,20	0,66% ▲	0,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.551.575,52	0,00	0,00	7.441.525,22	-110.050,30	-1,46% ▼	2,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	521.579,02	0,00	0,00	519.152,35	-2.426,67	-0,47% ▼	1,27%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.221.497,46	0,00	0,00	3.235.964,22	14.466,76	0,45% ▲	0,58%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.628.246,40	0,00	0,00	7.679.171,20	50.924,80	0,67% ▲	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	73.276.400,21	47.000,33	1.505.989,00	72.481.844,38	664.432,84	0,91% ▲	0,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	72.201,71	0,00	0,00	72.625,94	424,23	0,59% ▲	1,08%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.022.333,70	0,00	0,00	1.017.327,62	-5.006,08	-0,49% ▼	1,31%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	22.718.772,03	0,00	0,00	22.826.804,65	108.032,62	0,48% ▲	0,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.594.834,98	0,00	0,00	6.649.077,23	54.242,25	0,82% ▲	0,14%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1.621.081,55	0,00	0,00	1.623.950,03	2.868,48	0,18% ▲	1,05%
	380.793.486,10	47.000,33	1.505.989,00	382.304.829,45	2.970.332,02	0,78%	0,33%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	613.335,14	0,00	0,00	583.350,48	-29.984,66	-4,89% ▼	5,48%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	656.802,95	0,00	0,00	643.023,72	-13.779,23	-2,10% ▼	5,77%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	628.724,85	0,00	0,00	618.233,49	-10.491,36	-1,67% ▼	5,18%
-	1.898.862,94	0,00	0,00	1.844.607,69	-54.255,25	-2,86%	5,48%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	439.388,25	0,00	0,00	443.515,80	4.127,55	0,94% ▲	0,13%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	10.666.884,32	0,00	0,00	10.845.079,74	178.195,42	1,67% ▲	5,15%
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	292.893,90	0,00	0,00	291.638,51	-1.255,39	-0,43% ▼	1,24%
-	11.399.166,47	0,00	0,00	11.580.234,05	181.067,58	1,59%	4,86%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.914.389,58	0,00	0,00	4.063.072,51	148.682,93	3,80% ▲	7,33%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.348.206,80	0,00	0,00	8.728.955,19	380.748,39	4,56% ▲	5,69%
	12.262.596,38	0,00	0,00	12.792.027,70	529.431,32	4,32%	2,33%

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

