

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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	856.413,57	0,35%	5.834.557.206,92	0,01%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.424.514,35	1,39%	5.251.127.483,30	0,07%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.453.637,73	4,26%	2.636.302.220,38	0,40%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	566.509,88	0,23%	504.665.131,23	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.334.507,35	7,06%	1.871.533.642,91	0,93%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.814.733,32	1,55%	5.336.453.186,66	0,07%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	155.561,04	0,06%	5.245.527.378,78	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.349.036,18	6,66%	7.718.818.121,25	0,21%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.896.340,42	12,17%	5.008.664.499,36	0,60%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.577.940,85	2,27%	8.572.761.910,40	0,07%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.663.380,03	1,08%	1.608.068.056,62	0,17%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.850.964,90	1,98%	2.406.843.346,40	0,20%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	752.850,30	0,31%	12.594.877.640,69	0,01%	7º I b
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	7.406.049,05	3,02%	385.771.759,61	1,92%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5+ PREMIUM FIC RENDA FIXA	2.132.349,76	0,87%	370.712.410,27	0,58%	7º I b
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.416.817,27	0,98%	1.001.920.699,80	0,24%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.987.809,11	1,22%	16.400.080.186,89	0,02%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	7.777.700,05	3,17%	547.345.879,54	1,42%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.455.813,04	4,66%	9.205.921.475,18	0,12%	7º III a
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.947.262,95	1,61%	752.768.944,83	0,52%	7º III a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	6.599.542,77	2,69%	5.587.152.012,51	0,12%	7º III a
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	15.059.557,91	6,13%	467.744.830,38	3,22%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.234.438,97	2,95%	5.741.628.322,41	0,13%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	7.162.401,36	2,92%	2.392.878.891,76	0,30%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	573.166,99	0,23%	2.799.993.446,09	0,02%	7º III a
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.726.800,92	0,70%	4.995.409.968,68	0,03%	7º V b
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	1.067.468,71	0,43%	150.102.530,30	0,71%	8º I

Investimentos

\$ 245.602.772,61

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 245.602.772,61

Governança (Pró Gestão)



Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.943.979,94	1,61%	839.543.596,88	0,47%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.167.476,14	1,29%	552.699.682,41	0,57%	8º I
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	974.709,82	0,40%	29.899.679,42	3,26%	8º I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.129.401,33	0,46%	809.318.751,37	0,14%	8º I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.134.564,12	0,87%	405.845.091,47	0,53%	8º I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.599,27	0,00%	248.071.616,22	0,00%	8º I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	114.838,22	0,05%	425.388.318,76	0,03%	8º I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	428.569,64	0,17%	388.601.122,29	0,11%	8º I
OCCAM FIC AÇÕES	3.836.089,74	1,56%	897.850.630,50	0,43%	8º I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.939.923,41	1,20%	245.625.522,08	1,20%	8º I
SAFRA SMALL CAP PB FIC AÇÕES	2.727.863,18	1,11%	71.837.100,79	3,80%	8º I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	11.145.275,62	4,54%	134.010.666,17	8,32%	8º I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.068.688,19	3,69%	849.894.612,40	1,07%	8º I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.744.260,80	2,34%	955.761.755,90	0,60%	8º I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.846.726,37	0,75%	340.209.648,06	0,54%	9º III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.035.677,35	0,42%	485.677.409,40	0,21%	9º III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	5.848.377,95	2,38%	570.014.272,56	1,03%	10º I
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.165.552,81	0,47%	1.343.835.456,65	0,09%	10º I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	564.516,80	0,23%	536.250.132,68	0,11%	10º I
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	2.840.878,47	1,16%	340.439.675,78	0,83%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	10.691.234,66	4,35%	1.236.053.176,54	0,86%	10º I

Investimentos

\$ 245.602.772,61

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 245.602.772,61

Governança (Pró Gestão)

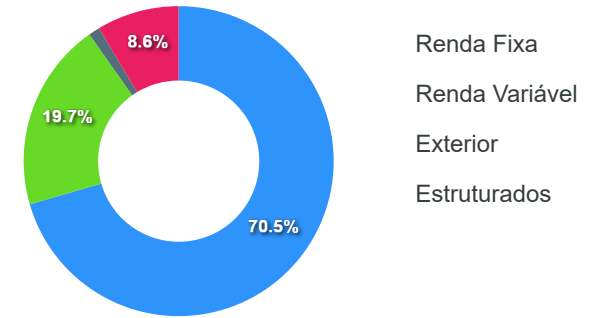
[☰](#)

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	44,25% 108.651.606,00	55,75% 136.901.514,09
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	25,57% 62.797.693,15	34,43% 84.534.178,90
7º V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	0,70% 1.726.800,92	4,30% 10.550.855,08
8º I - Fundos de Ações	30,00%	19,72% 48.433.708,13	10,28% 25.232.227,90
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,17% 2.882.403,72	8,83% 21.672.908,29
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	8,60% 21.110.560,69	1,40% 3.444.751,32

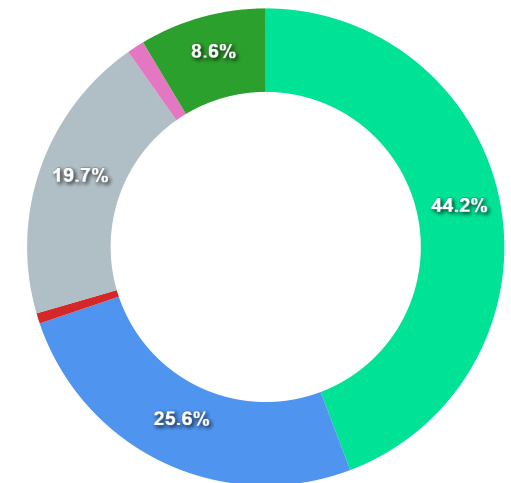
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos

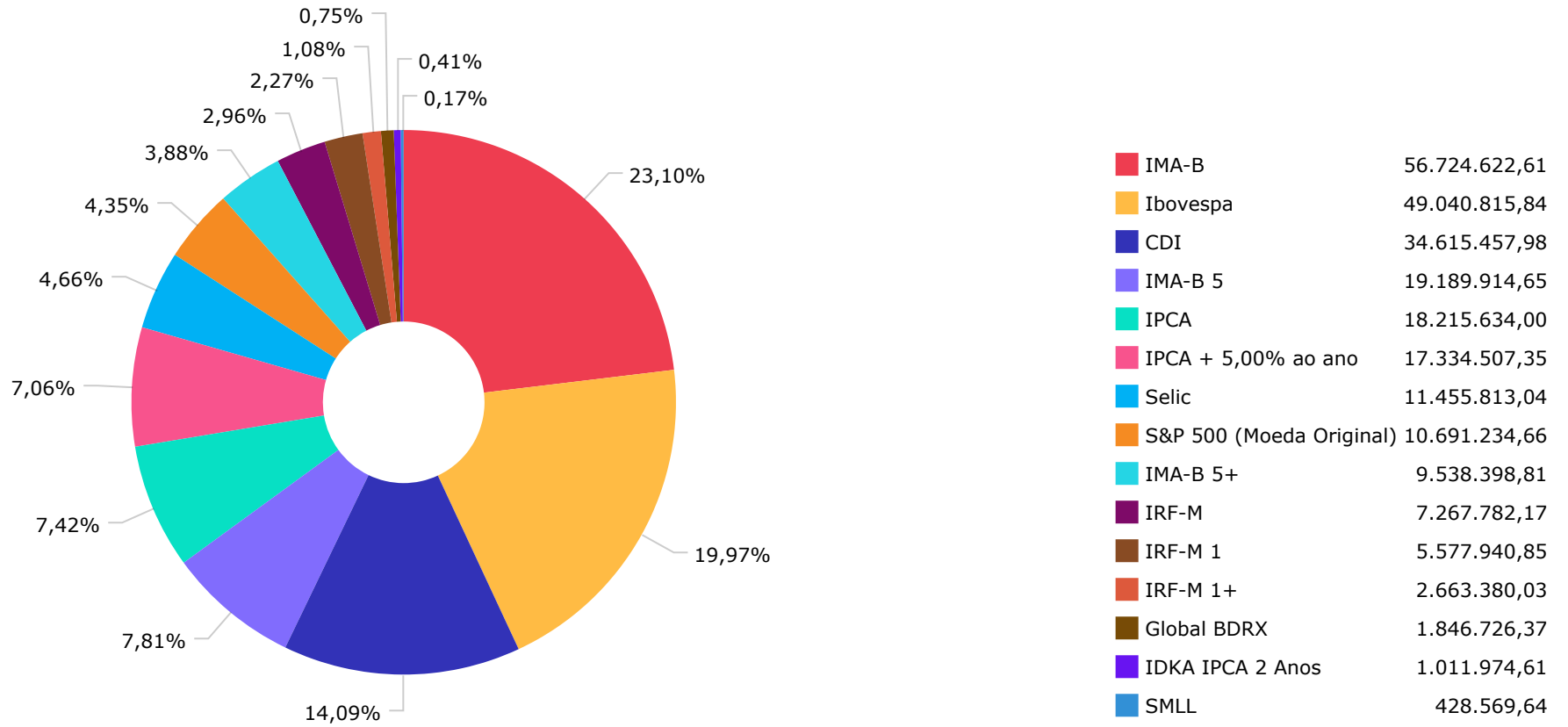


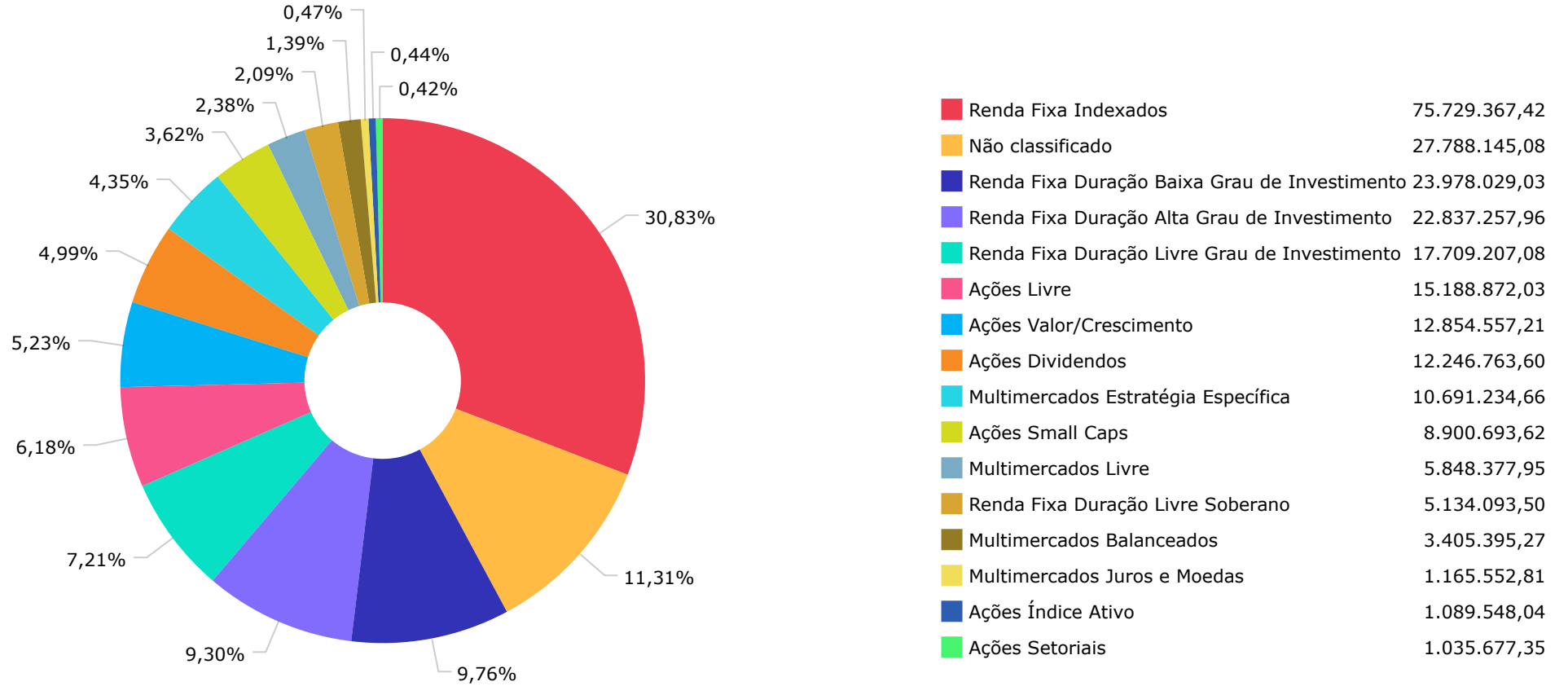
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	245.553.120,09	8° I - Fundos de Ações	19,72%	0,00%	21,00%	30,00%	25.232.227,90
7° I b - FI 100% Títulos TN	44,25%	0,00%	39,00%	100,00%	136.901.514,09	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	73.665.936,03
7° III a - FI Referenciados RF	25,57%	0,00%	27,00%	60,00%	84.534.178,90	9° III - Ações - BDR Nível I	1,17%	0,00%	1,00%	10,00%	21.672.908,29
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	49.110.624,02	10° I - Fundos Multimercados	8,60%	0,00%	4,00%	10,00%	3.444.751,32
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.277.656,00	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.277.656,00
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,70%	0,00%	1,00%	5,00%	10.550.855,08	11° - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.277.656,00
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.277.656,00						

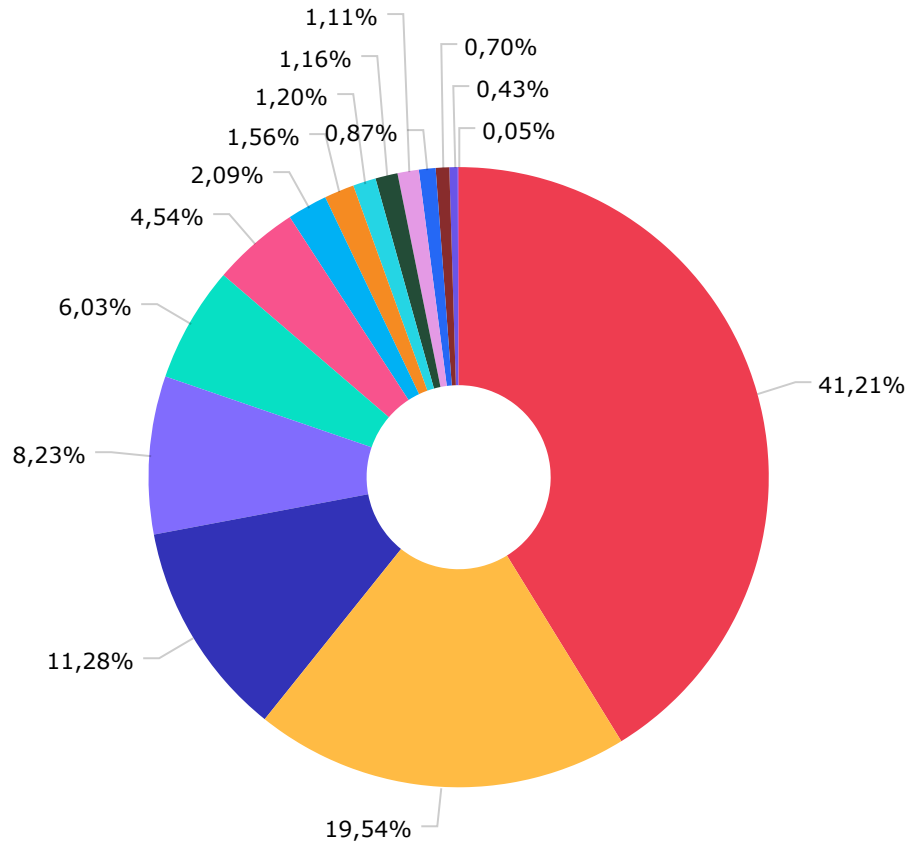
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33		
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,97	0,97	2,89	6,34	13,48	28,99	0,02	0,05
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,01	1,01	2,97	6,53	13,43	28,71	0,02	0,04
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,04	1,04	2,95	6,45	13,33	28,24	0,04	0,09
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,01	1,01	2,96	6,31	13,28	28,05	0,02	0,04
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
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95	0,95	2,78	5,94	12,79	27,22	0,02	0,04
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,90	0,90	3,29	5,13	12,54	26,56	0,21	0,45
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,93	0,93	2,81	5,52	12,33	27,52	0,09	0,20
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,68	-0,68	5,38	5,54	11,80	24,08	1,84	3,87
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,22	0,22	5,61	5,69	11,75	26,73	0,89	1,88
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	4,78	4,78	14,72	12,57	26,83	5,62		
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,73	0,73	11,75	3,69	12,64	8,83	7,90	16,64
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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,73	-2,73	18,05	7,36	20,43	25,72	7,00	14,74
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	-4,28	-4,28	13,55	5,07	20,10	18,53	6,66	14,03
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,73	-1,73	16,81	3,51	19,32	20,15	7,01	14,77
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,94	-2,94	12,20	7,53	15,86	32,13	5,07	10,68
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,77	-3,77	14,37	6,87	15,65	22,16	5,40	11,38
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-5,39	-5,39	12,97	3,60	15,23	15,99	6,58	13,86
SAFRA SMALL CAP PB FIC AÇÕES	-5,52	-5,52	15,91	-1,68	13,84	3,33	8,47	17,84
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-4,48	-4,48	12,20	2,57	10,06	11,76	5,97	12,56
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	-4,94	-4,94	12,90	2,49	9,52	14,91	6,16	12,97
OCCAM FIC AÇÕES	-3,79	-3,79	11,66	3,54	8,37	9,26	5,54	11,67

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-4,57	-4,57	13,44	3,06	7,75	3,66	5,68	11,97
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,91	-6,91	-1,10	-2,94	3,25	26,49	7,30	15,38
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	-4,33	-4,33	12,68	-0,91	3,02	9,96	5,54	11,68
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-7,81	-7,81	-3,19	-5,63	-1,03	11,28	7,33	15,43
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-B - BENCHMARK	-0,45	-0,45	4,97	2,91	15,53	23,80		
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
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,46	-0,46	4,79	2,62	15,28	23,07	1,28	2,69
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
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,56	-0,56	4,91	2,15	15,08	22,01	1,59	3,36
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11	1,11	2,84	2,68	4,90	9,69	0,33	0,70
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,68	0,68	3,99	4,44	11,33	23,79		
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	-0,96	-0,96	7,44	4,87	17,05	34,50	2,23	4,69
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		
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,48	-1,48	5,83	1,44	18,74	22,79	2,03	4,26
SANTANDER IMA-B 5+ PREMIUM FIC RENDA FIXA	-1,49	-1,49	5,82	1,42	18,47	22,55	2,03	4,28
IPCA - BENCHMARK	0,42	0,42	1,27	2,01	4,51	10,54		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,66	0,66	3,33	4,67	13,16	25,72	0,46	0,96
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,88	0,88	3,09	4,56	12,69	25,05	0,18	0,38

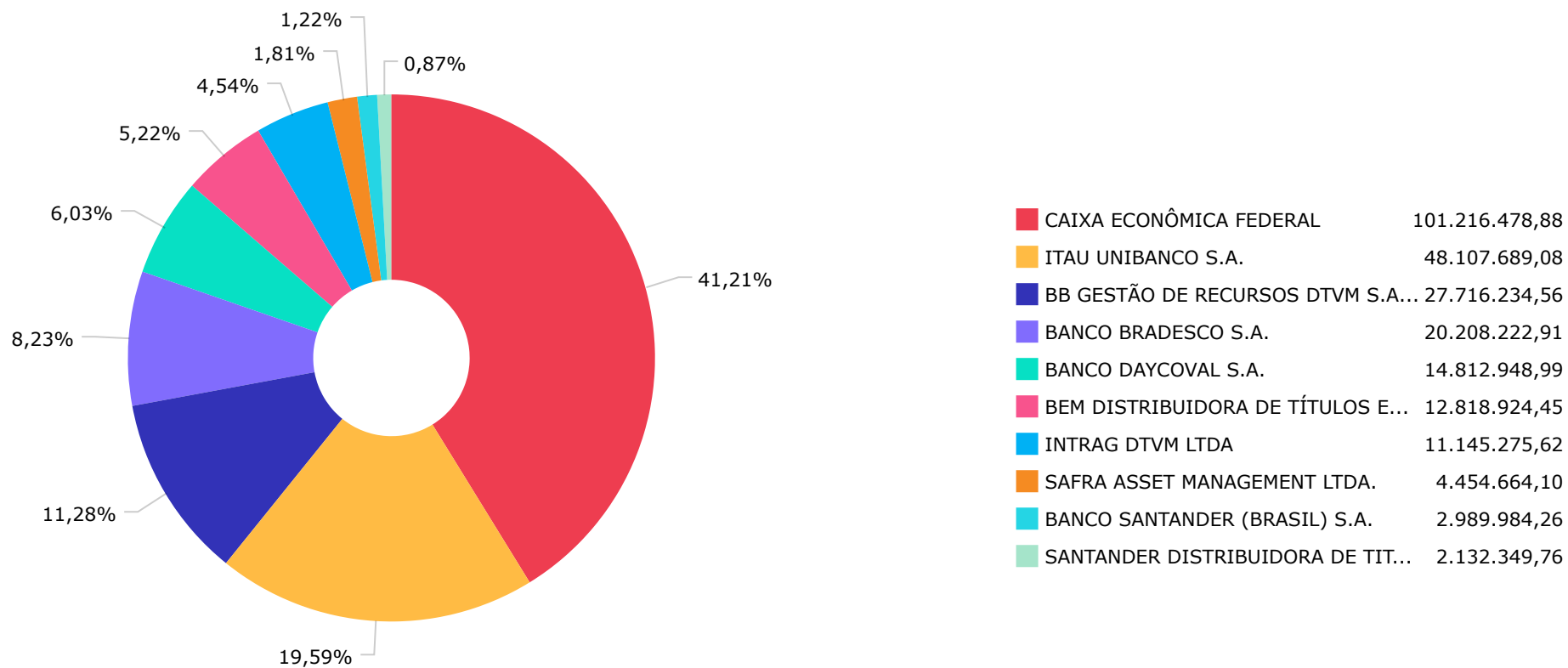
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12	1,12	2,87	5,42			0,33	0,70
IRF-M - BENCHMARK	0,67	0,67	4,68	6,05	16,31	27,74		
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,67	0,67	4,66	5,95	16,08	27,40	0,79	1,67
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,67	0,67	4,67	5,95	16,05	26,99	0,79	1,67
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
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		
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
SMLL - BENCHMARK	-6,55	-6,55	12,50	-6,30	6,34	-10,11		
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-5,76	-5,76	13,19	-5,09	6,01	-5,82	8,95	18,85
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







CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	101.216.478,88
ITAU UNIBANCO S.A.	47.992.850,86
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	27.716.234,56
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	20.208.222,91
TRIGONO CAPITAL LTDA.	14.812.948,99
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	11.145.275,62
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	5.122.334,02
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSO...	3.836.089,74
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	2.939.923,41
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECU...	2.840.878,47
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	2.727.863,18
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	2.134.564,12
BANCO J. SAFRA S.A	1.726.800,92
BAYES CAPITAL MANAGEMENT INVES...	1.067.468,71
ITAÚ DTVM S.A.	114.838,22



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	244.360.557,87	8.709.737,75	5.609.713,45	245.602.772,61	-1.857.809,56	-1.857.809,56	-0,75% ▼	-0,75%	0,85%	0,85%	-88,24%	2,19%

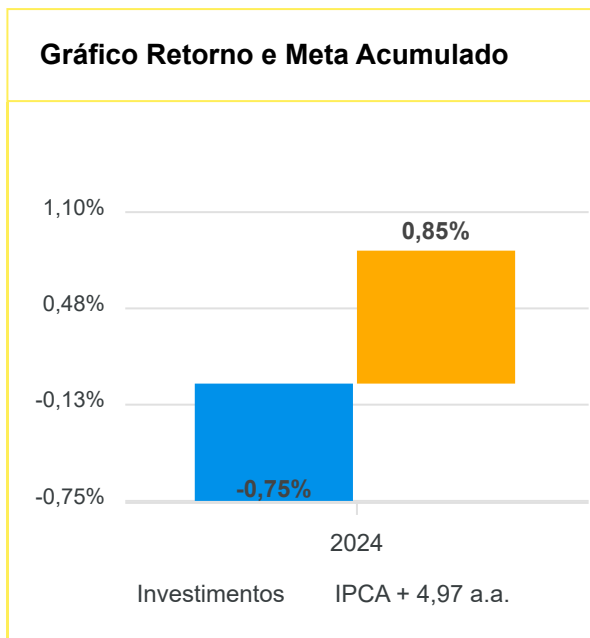
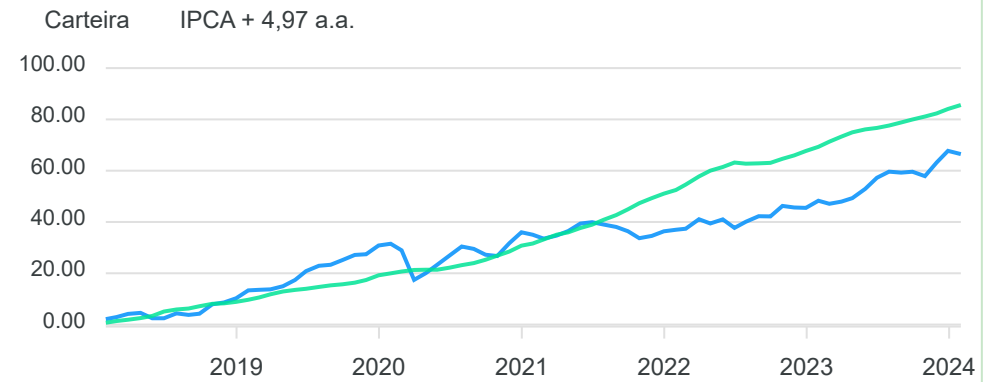


Gráfico Risco x Retorno

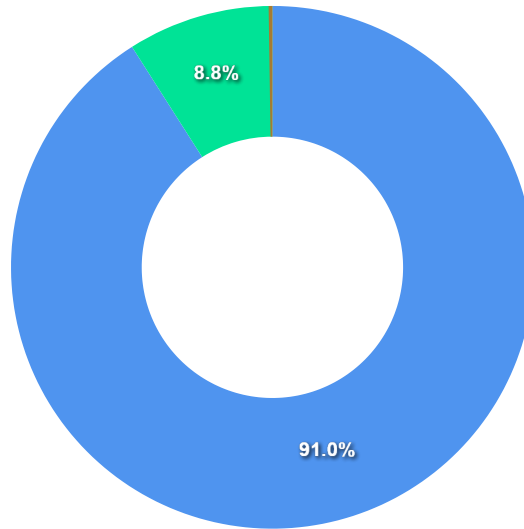


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/01/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	223.438.455,33	90,98
Até D+180	21.597.807,40	8,79
Até D+360	566.509,88	0,23
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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	850.360,43	0,00	0,00	856.413,57	6.053,14	0,71% ▲	0,57%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.441.089,63	0,00	0,00	3.424.514,35	-16.575,28	-0,48% ▼	1,28%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.959.201,43	0,00	0,00	2.987.809,11	28.607,68	0,97% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.338.255,20	0,00	0,00	10.453.637,73	115.382,53	1,12% ▲	0,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	7.813.309,25	0,00	0,00	7.777.700,05	-35.609,20	-0,46% ▼	1,28%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.071.090,40	1.262.657,92	0,00	11.455.813,04	122.064,72	1,08% ▲	0,07%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	560.314,05	0,00	0,00	566.509,88	6.195,83	1,11% ▲	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.143.303,68	0,00	0,00	17.334.507,35	191.203,67	1,12% ▲	0,33%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.912.647,50	0,00	0,00	3.947.262,95	34.615,45	0,88% ▲	0,18%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.789.906,68	0,00	0,00	3.814.733,32	24.826,64	0,66% ▲	0,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	154.434,53	0,00	0,00	155.561,04	1.126,51	0,73% ▲	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.264.585,14	0,00	23.420,30	16.349.036,18	107.871,34	0,66% ▲	0,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	31.080.023,76	2.481.148,24	3.532.227,18	29.896.340,42	-132.604,40	-0,40% ▼	1,27%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.618.897,36	2.965.931,59	2.054.065,97	5.577.940,85	47.177,87	0,62% ▲	0,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.647.822,59	0,00	0,00	2.663.380,03	15.557,44	0,59% ▲	1,08%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.818.600,12	0,00	0,00	4.850.964,90	32.364,78	0,67% ▲	0,79%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	6.533.765,32	0,00	0,00	6.599.542,77	65.777,45	1,01% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	745.762,30	0,00	0,00	752.850,30	7.088,00	0,95% ▲	0,02%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	7.517.401,14	0,00	0,00	7.406.049,05	-111.352,09	-1,48% ▼	2,03%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	15.144.077,47	0,00	0,00	15.059.557,91	-84.519,56	-0,56% ▼	1,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.162.280,34	0,00	0,00	7.234.438,97	72.158,63	1,01% ▲	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	7.098.258,66	0,00	0,00	7.162.401,36	64.142,70	0,90% ▲	0,21%
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.710.161,33	0,00	0,00	1.726.800,92	16.639,59	0,97% ▲	0,02%
SANTANDER IMA-B 5+ PREMIUM FIC RENDA FIXA	2.164.565,32	0,00	0,00	2.132.349,76	-32.215,56	-1,49% ▼	2,03%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	567.263,91	0,00	0,00	573.166,99	5.903,08	1,04% ▲	0,04%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.400.821,13	0,00	0,00	2.416.817,27	15.996,14	0,67% ▲	0,79%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
	171.508.198,67	6.709.737,75	5.609.713,45	173.176.100,07	567.877,10	0,33%	0,74%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	1.115.159,44	0,00	0,00	1.067.468,71	-47.690,73	-4,28% ▼	6,66%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.132.681,07	0,00	0,00	3.943.979,94	-188.701,13	-4,57% ▼	5,68%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.223.371,02	0,00	0,00	3.167.476,14	-55.894,88	-1,73% ▼	7,01%
BRANCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	1.018.830,29	0,00	0,00	974.709,82	-44.120,47	-4,33% ▼	5,54%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.161.105,65	0,00	0,00	1.129.401,33	-31.704,32	-2,73% ▼	7,00%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.256.120,40	0,00	0,00	2.134.564,12	-121.556,28	-5,39% ▼	6,58%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	11.014,71	0,00	0,00	10.599,27	-415,44	-3,77% ▼	5,40%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	120.218,28	0,00	0,00	114.838,22	-5.380,06	-4,48% ▼	5,97%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	454.781,36	0,00	0,00	428.569,64	-26.211,72	-5,76% ▼	8,95%
OCCAM FIC AÇÕES	3.987.324,39	0,00	0,00	3.836.089,74	-151.234,65	-3,79% ▼	5,54%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.013.932,70	2.000.000,00	0,00	2.939.923,41	-74.009,29	-2,46% ▼	5,07%
SAFRA SMALL CAP PB FIC AÇÕES	2.887.121,75	0,00	0,00	2.727.863,18	-159.258,57	-5,52% ▼	8,47%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	11.724.479,20	0,00	0,00	11.145.275,62	-579.203,58	-4,94% ▼	6,16%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.741.449,68	0,00	0,00	9.068.688,19	-672.761,49	-6,91% ▼	7,30%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.230.611,63	0,00	0,00	5.744.260,80	-486.350,83	-7,81% ▼	7,33%
-	49.078.201,57	2.000.000,00	0,00	48.433.708,13	-2.644.493,44	-5,18%	6,60%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	5.835.787,28	0,00	0,00	5.848.377,95	12.590,67	0,22% ▲	0,89%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.154.814,51	0,00	0,00	1.165.552,81	10.738,30	0,93% ▲	0,09%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	568.370,85	0,00	0,00	564.516,80	-3.854,05	-0,68% ▼	1,84%
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	2.868.537,37	0,00	0,00	2.840.878,47	-27.658,90	-0,96% ▼	2,23%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	10.515.567,08	0,00	0,00	10.691.234,66	175.667,58	1,67% ▲	5,15%
-	20.943.077,09	0,00	0,00	21.110.560,69	167.483,60	0,80%	3,21%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.833.302,47	0,00	0,00	1.846.726,37	13.423,90	0,73% ▲	7,90%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	997.778,07	0,00	0,00	1.035.677,35	37.899,28	3,80% ▲	7,33%
	2.831.080,54	0,00	0,00	2.882.403,72	51.323,18	1,81%	5,06%

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

