

# 2024

## Relatório Mensal e 1º trimestre de 2024

# Março

## 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	8.705.953,61	10,75%	0,00		7º I a
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	648.597,43	0,80%	1.570.682.197,15	0,04%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.904.196,86	3,59%	5.324.825.927,52	0,05%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	231.939,69	0,29%	192.185.931,64	0,12%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.162.667,25	2,67%	3.594.188.246,07	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.276.337,08	1,58%	7.792.392.111,13	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.203.298,32	10,13%	2.457.483.202,76	0,33%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2.145.431,04	2,65%	542.920.318,57	0,40%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.824.256,51	3,49%	4.354.660.093,34	0,06%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	14.705.438,54	18,16%	16.860.564.075,44	0,09%	7º III a
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1.835.477,71	2,27%	850.459.230,83	0,22%	7º III a
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.382.747,85	4,18%	10.645.688.775,75	0,03%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.303.140,98	12,72%	16.216.695.874,70	0,06%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2.062.058,04	2,55%	1.280.284.121,42	0,16%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.831.043,01	2,26%	2.837.635.942,66	0,06%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.178.569,30	1,46%	630.817.036,59	0,19%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	975.763,91	1,21%	1.264.529.645,55	0,08%	8º I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.874.748,17	2,32%	794.659.485,32	0,24%	8º I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.353.071,71	2,91%	755.856.831,55	0,31%	8º I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	921.951,42	1,14%	321.295.185,41	0,29%	8º I
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	414.552,56	0,51%	545.311.039,87	0,08%	8º I
BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.130.901,62	1,40%	652.744.629,19	0,17%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.880.673,41	2,32%	403.708.829,62	0,47%	8º I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.515.948,15	1,87%	1.012.819.607,56	0,15%	8º I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.384.956,11	1,71%	736.182.331,30	0,19%	8º I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	211.133,05	0,26%	658.987.760,05	0,03%	8º I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	551.373,31	0,68%	205.683.802,42	0,27%	8º I

## Investimentos

\$ 80.975.484,75

## Disponibilidades Financeiras

\$ 732.703,55

## Total Carteira

\$ 81.708.188,30

## Governança (Pró Gestão)

 NIVEL 2 15/02/2025

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	387.488,23	0,48%	104.813.751,52	0,37%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	967.949,94	1,20%	2.280.222.056,45	0,04%	9º III
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.003.819,94	2,47%	54.503.902,40	3,68%	10º I

## Investimentos

\$ 80.975.484,75


## Disponibilidades Financeiras

\$ 732.703,55

## Total Carteira

\$ 81.708.188,30

## Governança (Pró Gestão)

 NIVEL 2 15/02/2025

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	09/11/2021	Curva - Taxa: 5,2500%	250	4.455,31643	1.113.829,11
NTN-B - 15/08/2040	09/11/2021	Curva - Taxa: 5,2800%	250	4.619,815397	1.154.953,85
NTN-B - 15/08/2040	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,4900%	240	4.521,56162	1.085.174,79
NTN-B - 15/05/2045	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6001%	200	4.565,973109	913.194,62
NTN-B - 15/05/2045	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6001%	25	4.565,973109	114.149,33
NTN-B - 15/08/2050	05/11/2021	Curva - Taxa: 5,2400%	240	4.750,111777	1.140.026,83
NTN-B - 15/08/2050	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6001%	240	4.528,309445	1.086.794,27
NTN-B - 15/08/2050	15/07/2022	Curva - Taxa: 6,3200%	508	4.129,588235	2.097.830,82

Investimentos

\$ 80.975.484,75


Disponibilidades Financeiras

\$ 732.703,55

Total Carteira

\$ 81.708.188,30

Governança (Pró Gestão)

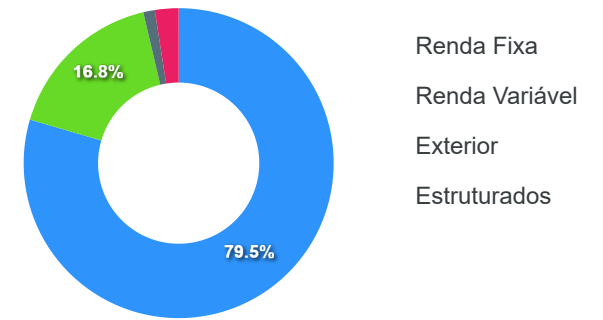
 NIVEL 2 15/02/2025

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	10,72% 8.705.953,61	89,28% 72.480.577,39
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	21,64% 17.572.467,67	78,36% 63.614.063,33
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	46,96% 38.122.731,94	23,04% 18.707.839,76
8º I - Fundos de Ações	40,00%	16,75% 13.602.561,65	23,25% 18.872.050,75
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,19% 967.949,94	8,81% 7.150.703,16
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	2,47% 2.003.819,94	7,53% 6.114.833,16

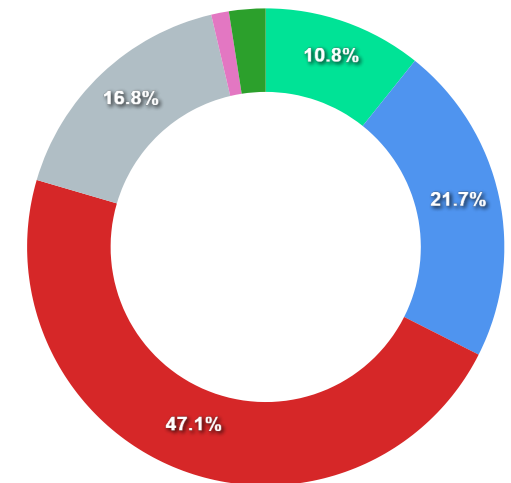
Governança (Pró Gestão)

🔗 NIVEL 2 15/02/2025

Segmentos



Artigos

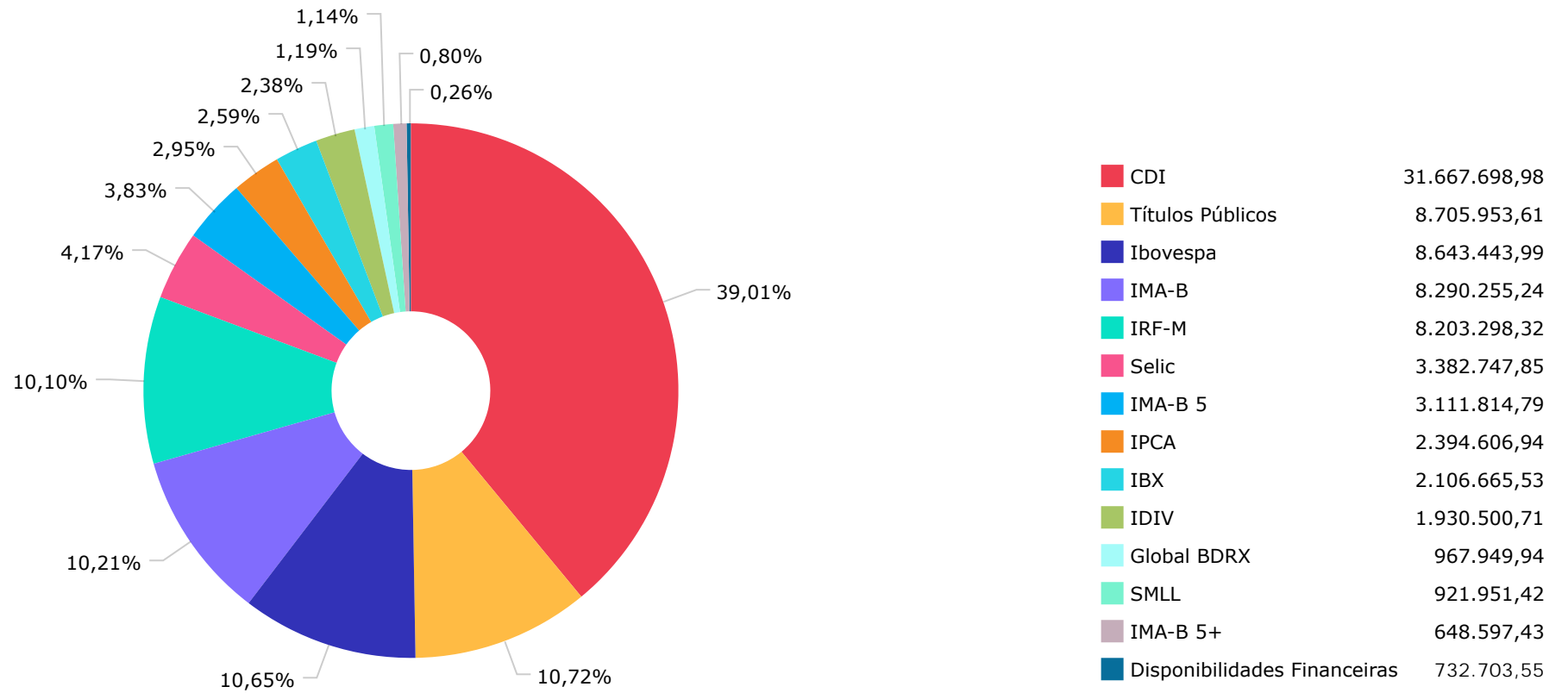


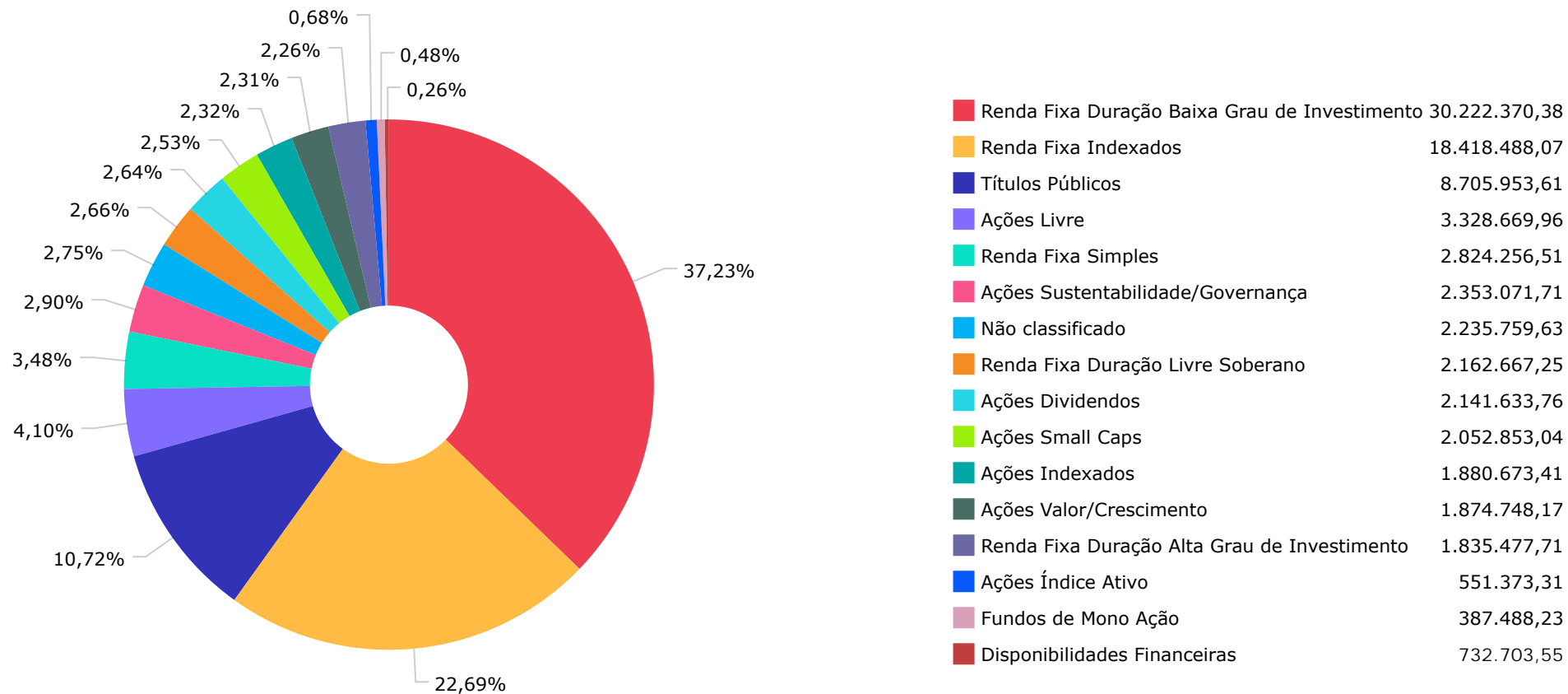
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	10,72%	0,00%	10,00%	100,00%	72.480.577,39	8° I - Fundos de Ações	16,75%	0,00%	17,00%	40,00%	18.872.050,75
7° I b - FI 100% Títulos TN	21,64%	0,00%	19,00%	100,00%	63.614.063,33	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	32.474.612,40
7° III a - FI Referenciados RF	46,96%	0,00%	48,00%	70,00%	18.707.839,76	9° III - Ações - BDR Nível I	1,19%	0,00%	1,00%	10,00%	7.150.703,16
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	16.237.306,20	10° I - Fundos Multimercados	2,47%	0,00%	1,00%	10,00%	6.114.833,16
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.118.653,10	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.059.326,55
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	8.118.653,10						
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	8.118.653,10						

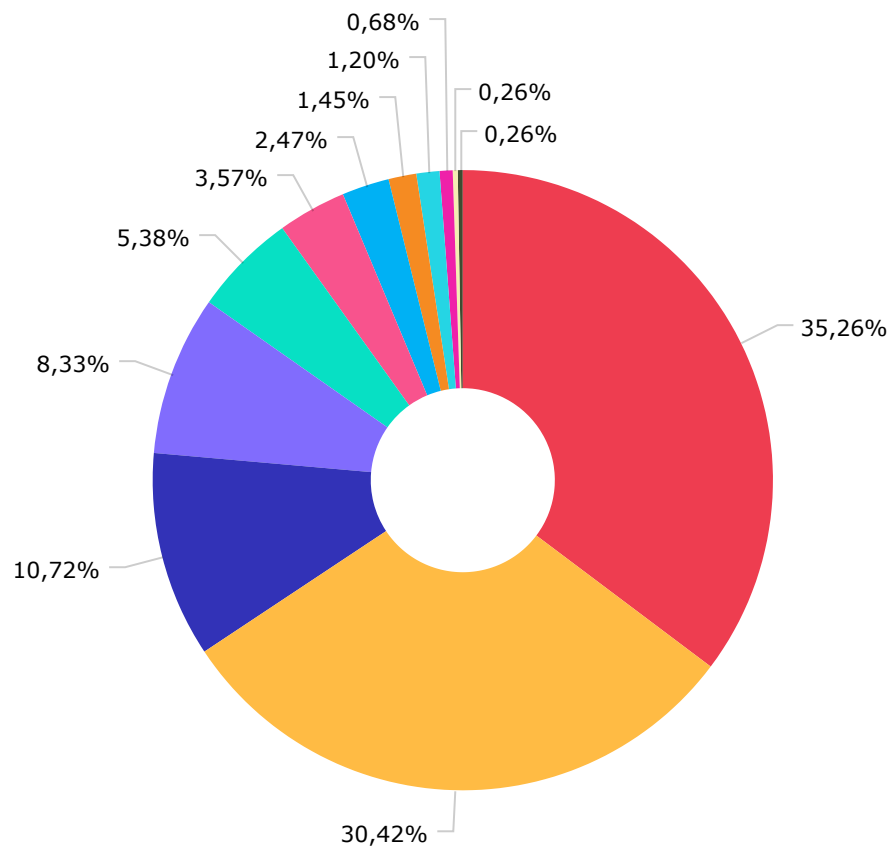
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>CDI - BENCHMARK</b>	<b>0,83</b>	<b>2,62</b>	<b>2,62</b>	<b>5,54</b>	<b>12,36</b>	<b>27,28</b>		
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	3,52	8,92	8,92	19,41	32,36		3,89	8,19
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,86	2,79	2,79	5,80	13,09	28,17	0,02	0,04
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,87	2,72	2,72	5,74	12,93	27,88	0,01	0,03
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,85	2,65	2,65	5,55	12,40	27,30	0,01	0,03
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75	2,38	2,38	5,02	11,27	24,78	0,01	0,02
<b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>	<b>4,04</b>	<b>15,88</b>	<b>15,88</b>	<b>24,88</b>	<b>34,65</b>	<b>30,56</b>		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,48	14,98	14,98	23,77	32,44	27,69	5,89	12,41
<b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>	<b>-0,71</b>	<b>-4,53</b>	<b>-4,53</b>	<b>9,90</b>	<b>25,74</b>	<b>6,76</b>		
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	-7,06	-2,33	-2,33	3,39	72,34	104,47	20,51	43,20
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-0,44	-3,57	-3,57	10,25	25,42	4,21	5,22	10,99
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-0,70	-4,51	-4,51	9,74	25,17	6,73	4,94	10,41
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-0,50	-4,18	-4,18	9,30	24,86	3,40	5,24	11,03
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	-0,89	-3,17	-3,17	9,72	24,55	2,14	5,72	12,04
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,27	-4,27	-4,27	9,48	20,76	-0,83	5,21	10,97
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,83	-4,10	-4,10	7,51	20,05	3,96	4,48	9,43
<b>IBX - BENCHMARK</b>	<b>-0,73</b>	<b>-4,29</b>	<b>-4,29</b>	<b>10,02</b>	<b>25,18</b>	<b>5,09</b>		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2,89	1,36	1,36	10,39	23,62	0,40	4,31	9,08
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-0,11	-5,08	-5,08	4,69	9,20	-19,36	7,83	16,49
<b>IDIV - BENCHMARK</b>	<b>-1,20</b>	<b>-3,81</b>	<b>-3,81</b>	<b>10,25</b>	<b>27,20</b>	<b>19,02</b>		
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-1,01	-2,33	-2,33	10,04	26,45	13,34	4,06	8,56
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,38	-3,11	-3,11	10,84	24,53	10,50	4,71	9,92

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>IMA-B - BENCHMARK</b>	<b>0,08</b>	<b>0,18</b>	<b>0,18</b>	<b>4,94</b>	<b>11,81</b>	<b>20,21</b>		
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,10	0,20	0,20	4,97	11,90	19,88	1,10	2,31
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,04	0,06	0,06	4,86	11,67	19,79	1,11	2,34
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06	0,11	0,11	4,82	11,56	19,65	1,09	2,29
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	0,05	0,10	0,10	4,80	11,54	19,61	1,08	2,28
<b>IMA-B 5 - BENCHMARK</b>	<b>0,77</b>	<b>2,06</b>	<b>2,06</b>	<b>5,09</b>	<b>9,62</b>	<b>21,01</b>		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,75	2,01	2,01	4,98	9,48	20,72	0,44	0,93
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,74	1,97	1,97	4,93	9,33	20,22	0,44	0,93
<b>IMA-B 5+ - BENCHMARK</b>	<b>-0,55</b>	<b>-1,51</b>	<b>-1,51</b>	<b>4,82</b>	<b>13,38</b>	<b>19,08</b>		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,59	-1,61	-1,61	4,66	13,00	18,25	1,71	3,59
<b>IPCA - BENCHMARK</b>	<b>0,16</b>	<b>1,42</b>	<b>1,42</b>	<b>2,51</b>	<b>3,93</b>	<b>8,76</b>		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92	2,78	2,78	5,01	9,81	20,12	0,20	0,42
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91	2,77	2,77	4,98	9,78	21,57	0,20	0,42
<b>IRF-M - BENCHMARK</b>	<b>0,54</b>	<b>1,68</b>	<b>1,68</b>	<b>6,13</b>	<b>14,03</b>	<b>27,20</b>		
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50	1,61	1,61	6,01	13,79	26,76	0,72	1,51
<b>SELIC - BENCHMARK</b>	<b>0,83</b>	<b>2,62</b>	<b>2,62</b>	<b>5,54</b>	<b>12,36</b>	<b>27,28</b>		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91	2,92	2,92	6,02	13,31	28,84	0,03	0,06
<b>SMLL - BENCHMARK</b>	<b>2,15</b>	<b>-4,09</b>	<b>-4,09</b>	<b>6,93</b>	<b>24,13</b>	<b>-10,57</b>		
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1,78	-4,32	-4,32	5,50	24,72	-12,50	7,22	15,21

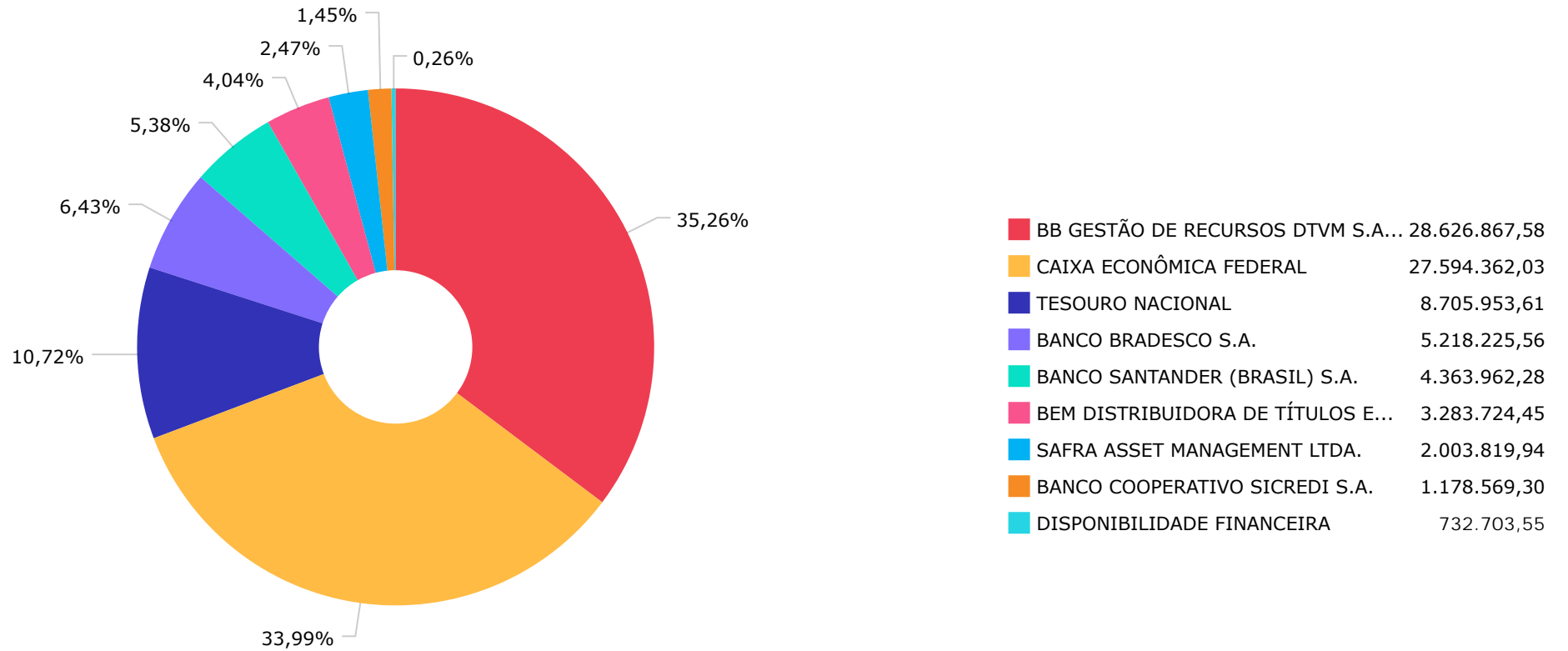








BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	28.626.867,58
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	24.693.457,77
TESOURO NACIONAL	8.705.953,61
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	6.763.679,74
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	4.363.962,28
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU...	2.900.904,26
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	2.003.819,94
CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ...	1.178.569,30
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	975.763,91
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	551.373,31
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECU...	211.133,05
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	732.703,55

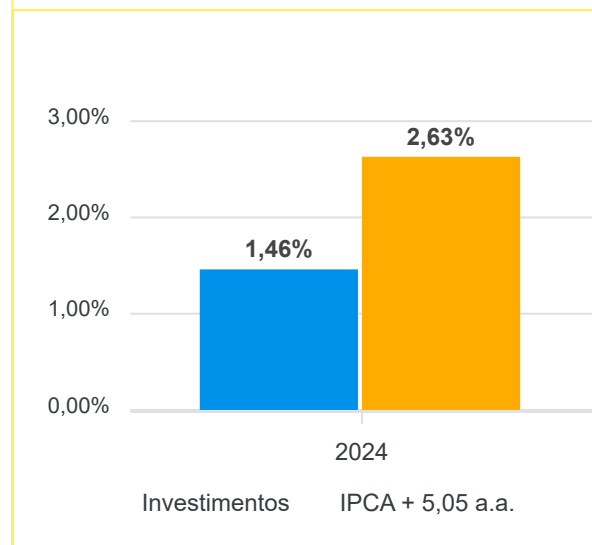


Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	78.915.388,20	610.771,22	334.773,31	79.118.692,45	-72.693,66	-72.693,66	-0,09% ▼	-0,09%	0,85%	0,85%	-10,59%	1,52%
Fevereiro	79.118.692,45	1.071.872,38	806.533,67	80.109.153,08	725.121,92	652.428,26	0,91% ▲	0,82%	1,21%	2,07%	39,61%	1,65%
Março	80.109.153,08	781.814,86	422.656,88	80.975.484,75	507.173,69	1.159.601,95	0,63% ▲	1,46%	0,55%	2,63%	55,51%	1,36%

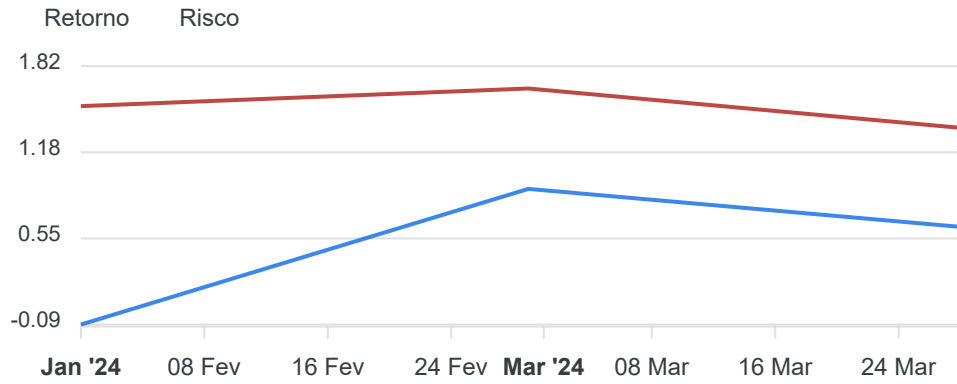
Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	1.159.601,95	1,46%	2,63%

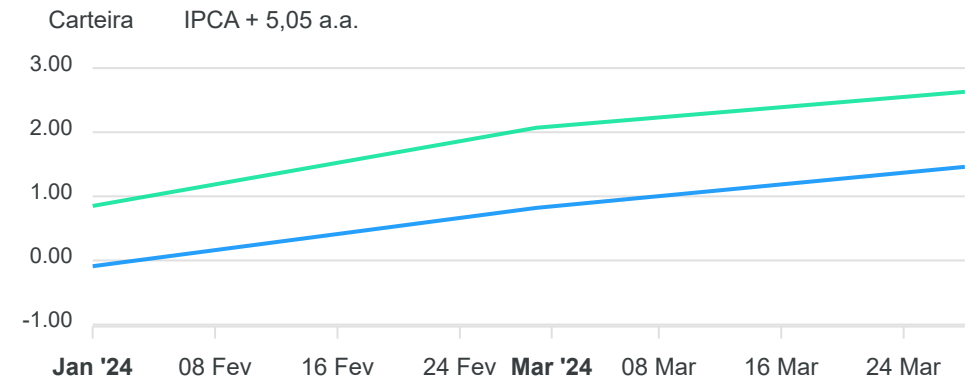
**Gráfico Retorno e Meta Acumulado**



**Gráfico Risco x Retorno**

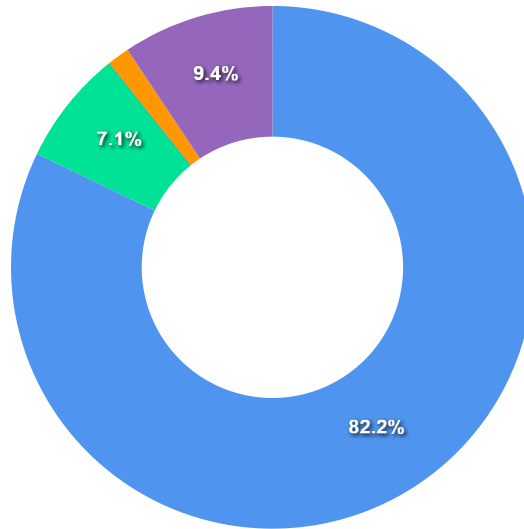


**Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade**



**Liquidez - 28/03/2024**

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	66.695.274,13	82,36
Até D+180	5.785.303,26	7,14
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	1.113.829,11	1,38
Acima D+3600	7.592.124,50	9,38
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	8.620.643,76	0,00	0,00	8.705.953,61	85.309,85	0,99% ▲	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.443.121,45	781.814,86	422.656,88	2.824.256,51	21.977,08	0,68% ▲	0,01%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	652.422,67	0,00	0,00	648.597,43	-3.825,24	-0,59% ▼	1,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.902.466,62	0,00	0,00	2.904.196,86	1.730,24	0,06% ▲	1,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	14.581.090,33	0,00	0,00	14.705.438,54	124.348,21	0,85% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	229.847,43	0,00	0,00	231.939,69	2.092,26	0,91% ▲	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.143.006,09	0,00	0,00	2.162.667,25	19.661,16	0,92% ▲	0,20%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1.822.024,74	0,00	0,00	1.835.477,71	13.452,97	0,74% ▲	0,44%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.352.227,55	0,00	0,00	3.382.747,85	30.520,30	0,91% ▲	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.214.433,33	0,00	0,00	10.303.140,98	88.707,65	0,87% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.266.801,99	0,00	0,00	1.276.337,08	9.535,09	0,75% ▲	0,44%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.162.478,63	0,00	0,00	8.203.298,32	40.819,69	0,50% ▲	0,72%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2.059.981,75	0,00	0,00	2.062.058,04	2.076,29	0,10% ▲	1,10%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2.144.282,08	0,00	0,00	2.145.431,04	1.148,96	0,05% ▲	1,08%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.815.362,40	0,00	0,00	1.831.043,01	15.680,61	0,86% ▲	0,02%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.178.144,20	0,00	0,00	1.178.569,30	425,10	0,04% ▲	1,11%
	63.588.335,02	781.814,86	422.656,88	64.401.153,22	453.660,22	0,71%	0,28%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	948.364,08	0,00	0,00	975.763,91	27.399,83	2,89% ▲	4,31%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.879.786,02	0,00	0,00	1.874.748,17	-5.037,85	-0,27% ▼	5,21%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.364.791,57	0,00	0,00	2.353.071,71	-11.719,86	-0,50% ▼	5,24%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	905.806,56	0,00	0,00	921.951,42	16.144,86	1,78% ▲	7,22%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	416.135,13	0,00	0,00	414.552,56	-1.582,57	-0,38% ▼	4,71%
BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.132.147,39	0,00	0,00	1.130.901,62	-1.245,77	-0,11% ▼	7,83%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVSPA FI AÇÕES	1.894.024,45	0,00	0,00	1.880.673,41	-13.351,04	-0,70% ▼	4,94%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.531.400,96	0,00	0,00	1.515.948,15	-15.452,81	-1,01% ▼	4,06%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.391.059,24	0,00	0,00	1.384.956,11	-6.103,13	-0,44% ▼	5,22%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	212.910,12	0,00	0,00	211.133,05	-1.777,07	-0,83% ▼	4,48%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	556.300,23	0,00	0,00	551.373,31	-4.926,92	-0,89% ▼	5,72%
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	416.940,97	0,00	0,00	387.488,23	-29.452,74	-7,06% ▼	20,51%
-	13.649.666,72	0,00	0,00	13.602.561,65	-47.105,07	-0,35%	5,77%



ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1.935.734,13	0,00	0,00	2.003.819,94	68.085,81	3,52% ▲	3,89%
-	1.935.734,13	0,00	0,00	2.003.819,94	68.085,81	3,52%	3,89%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	935.417,21	0,00	0,00	967.949,94	32.532,73	3,48% ▲	5,89%
	935.417,21	0,00	0,00	967.949,94	32.532,73	3,48%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.485.673,51	2.464.458,46	1.180.943,85	2.824.256,51	55.068,39	1,39% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	659.224,25	0,00	0,00	648.597,43	-10.626,82	-1,61% ▼
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.901.118,35	0,00	0,00	2.904.196,86	3.078,51	0,11% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	14.326.421,01	0,00	0,00	14.705.438,54	379.017,53	2,65% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	232.346,89	0,00	6.763,38	231.939,69	6.356,18	2,74% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.164.213,60	0,00	61.057,38	2.162.667,25	59.511,03	2,75% ▲
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1.800.042,81	0,00	0,00	1.835.477,71	35.434,90	1,97% ▲
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.286.740,48	0,00	0,00	3.382.747,85	96.007,37	2,92% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.030.267,29	0,00	0,00	10.303.140,98	272.873,69	2,72% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.251.231,38	0,00	0,00	1.276.337,08	25.105,70	2,01% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.072.947,41	0,00	0,00	8.203.298,32	130.350,91	1,61% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2.057.987,96	0,00	0,00	2.062.058,04	4.070,08	0,20% ▲
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2.143.195,44	0,00	0,00	2.145.431,04	2.235,60	0,10% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.879.773,47	0,00	100.000,00	1.831.043,01	51.269,54	2,73% ▲
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.177.858,11	0,00	0,00	1.178.569,30	711,19	0,06% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	8.661.179,35	0,00	215.199,25	8.705.953,61	259.973,51	3,00% ▲
	62.130.221,31	2.464.458,46	1.563.963,86	64.401.153,22	1.370.437,31	2,17%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	962.670,39	0,00	0,00	975.763,91	13.093,52	1,36% ▲
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.958.300,94	0,00	0,00	1.874.748,17	-83.552,77	-4,27% ▼
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.455.784,77	0,00	0,00	2.353.071,71	-102.713,06	-4,18% ▼
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	963.555,48	0,00	0,00	921.951,42	-41.604,06	-4,32% ▼
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	427.860,40	0,00	0,00	414.552,56	-13.307,84	-3,11% ▼
BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.191.412,68	0,00	0,00	1.130.901,62	-60.511,06	-5,08% ▼
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESA FI AÇÕES	1.969.464,17	0,00	0,00	1.880.673,41	-88.790,76	-4,51% ▼
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.552.049,80	0,00	0,00	1.515.948,15	-36.101,65	-2,33% ▼
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.436.254,30	0,00	0,00	1.384.956,11	-51.298,19	-3,57% ▼
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	220.169,44	0,00	0,00	211.133,05	-9.036,39	-4,10% ▼
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	569.433,80	0,00	0,00	551.373,31	-18.060,49	-3,17% ▼
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	396.731,33	0,00	0,00	387.488,23	-9.243,10	-2,33% ▼
	14.103.687,50	0,00	0,00	13.602.561,65	-501.125,85	-3,55%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1.839.644,66	0,00	0,00	2.003.819,94	164.175,28	8,92% ▲
	1.839.644,66	0,00	0,00	2.003.819,94	164.175,28	8,92%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	841.834,73	0,00	0,00	967.949,94	126.115,21	14,98% ▲
	841.834,73	0,00	0,00	967.949,94	126.115,21	14,98%

## Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **IMPREV INST MUNC PREV VIRADOURO - SP** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Março/2024**, atestando os dados relativos à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

## Aprovação do Conselho Fiscal

O Conselho Fiscal do **IMPREV INST MUNC PREV VIRADOURO - SP** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Março/2024** bem como o parecer do Comitê de Investimentos, que tratam do acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do **IMPREV INST MUNC PREV VIRADOURO - SP** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.





# 2024

## Relatório

### Mensal e 1º trimestre de 2024

## Março

## 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	8.705.953,61	10,75%	0,00		7º I a
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	648.597,43	0,80%	1.570.682.197,15	0,04%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.904.196,86	3,59%	5.324.825.927,52	0,05%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	231.939,69	0,29%	192.185.931,64	0,12%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.162.667,25	2,67%	3.594.188.246,07	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.276.337,08	1,58%	7.792.392.111,13	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.203.298,32	10,13%	2.457.483.202,76	0,33%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2.145.431,04	2,65%	542.920.318,57	0,40%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.824.256,51	3,49%	4.354.660.093,34	0,06%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	14.705.438,54	18,16%	16.860.564.075,44	0,09%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1.835.477,71	2,27%	850.459.230,83	0,22%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.382.747,85	4,18%	10.645.688.775,75	0,03%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.303.140,98	12,72%	16.216.695.874,70	0,06%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2.062.058,04	2,55%	1.280.284.121,42	0,16%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.831.043,01	2,26%	2.837.635.942,66	0,06%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.178.569,30	1,46%	630.817.036,59	0,19%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	975.763,91	1,21%	1.264.529.645,55	0,08%	8º I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.874.748,17	2,32%	794.659.485,32	0,24%	8º I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.353.071,71	2,91%	755.856.831,55	0,31%	8º I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	921.951,42	1,14%	321.295.185,41	0,29%	8º I
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	414.552,56	0,51%	545.311.039,87	0,08%	8º I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.130.901,62	1,40%	652.744.629,19	0,17%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.880.673,41	2,32%	403.708.829,62	0,47%	8º I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.515.948,15	1,87%	1.012.819.607,56	0,15%	8º I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.384.956,11	1,71%	736.182.331,30	0,19%	8º I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	211.133,05	0,26%	658.987.760,05	0,03%	8º I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	551.373,31	0,68%	205.683.802,42	0,27%	8º I

**Investimentos**

\$ 80.975.484,75

**Disponibilidades Financeiras**

\$ 732.703,55

**Total Carteira**

\$ 81.708.188,30

**Governança (Pró Gestão)**
 NIVEL 2 15/02/2025

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	387.488,23	0,48%	104.813.751,52	0,37%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	967.949,94	1,20%	2.280.222.056,45	0,04%	9º III
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.003.819,94	2,47%	54.503.902,40	3,68%	10º I


## Investimentos

 80.975.484,75


## Disponibilidades Financeiras

 732.703,55

## Total Carteira

 81.708.188,30

## Governança (Pró Gestão)

 NIVEL 2 15/02/2025

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	09/11/2021	Curva - Taxa: 5,2500%	250	4.455,31643	1.113.829,11
NTN-B - 15/08/2040	09/11/2021	Curva - Taxa: 5,2800%	250	4.619,815397	1.154.953,85
NTN-B - 15/08/2040	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,4900%	240	4.521,56162	1.085.174,79
NTN-B - 15/05/2045	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6001%	200	4.565,973109	913.194,62
NTN-B - 15/05/2045	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6001%	25	4.565,973109	114.149,33
NTN-B - 15/08/2050	05/11/2021	Curva - Taxa: 5,2400%	240	4.750,111777	1.140.026,83
NTN-B - 15/08/2050	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6001%	240	4.528,309445	1.086.794,27
NTN-B - 15/08/2050	15/07/2022	Curva - Taxa: 6,3200%	508	4.129,588235	2.097.830,82

**Investimentos**


\$ 80.975.484,75

**Disponibilidades Financeiras**

\$ 732.703,55

**Total Carteira**

\$ 81.708.188,30

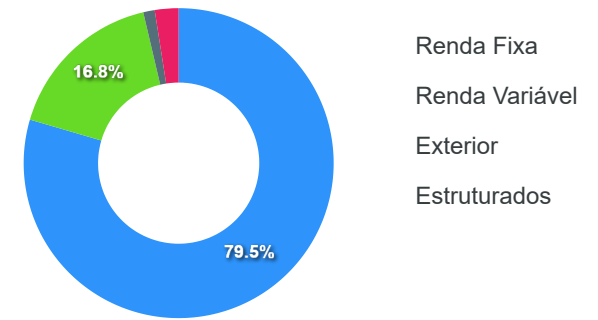
**Governança (Pró Gestão)**
 NIVEL 2 15/02/2025

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	10,72% 8.705.953,61	89,28% 72.480.577,39
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	21,64% 17.572.467,67	78,36% 63.614.063,33
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	46,96% 38.122.731,94	23,04% 18.707.839,76
8º I - Fundos de Ações	40,00%	16,75% 13.602.561,65	23,25% 18.872.050,75
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,19% 967.949,94	8,81% 7.150.703,16
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	2,47% 2.003.819,94	7,53% 6.114.833,16

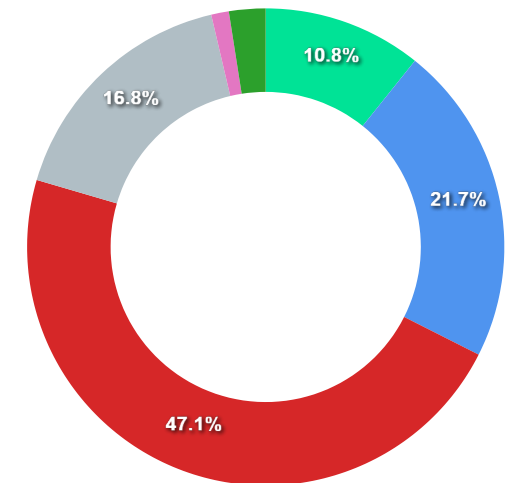
Governança (Pró Gestão)

🔗 NIVEL 2 15/02/2025

Segmentos



Artigos

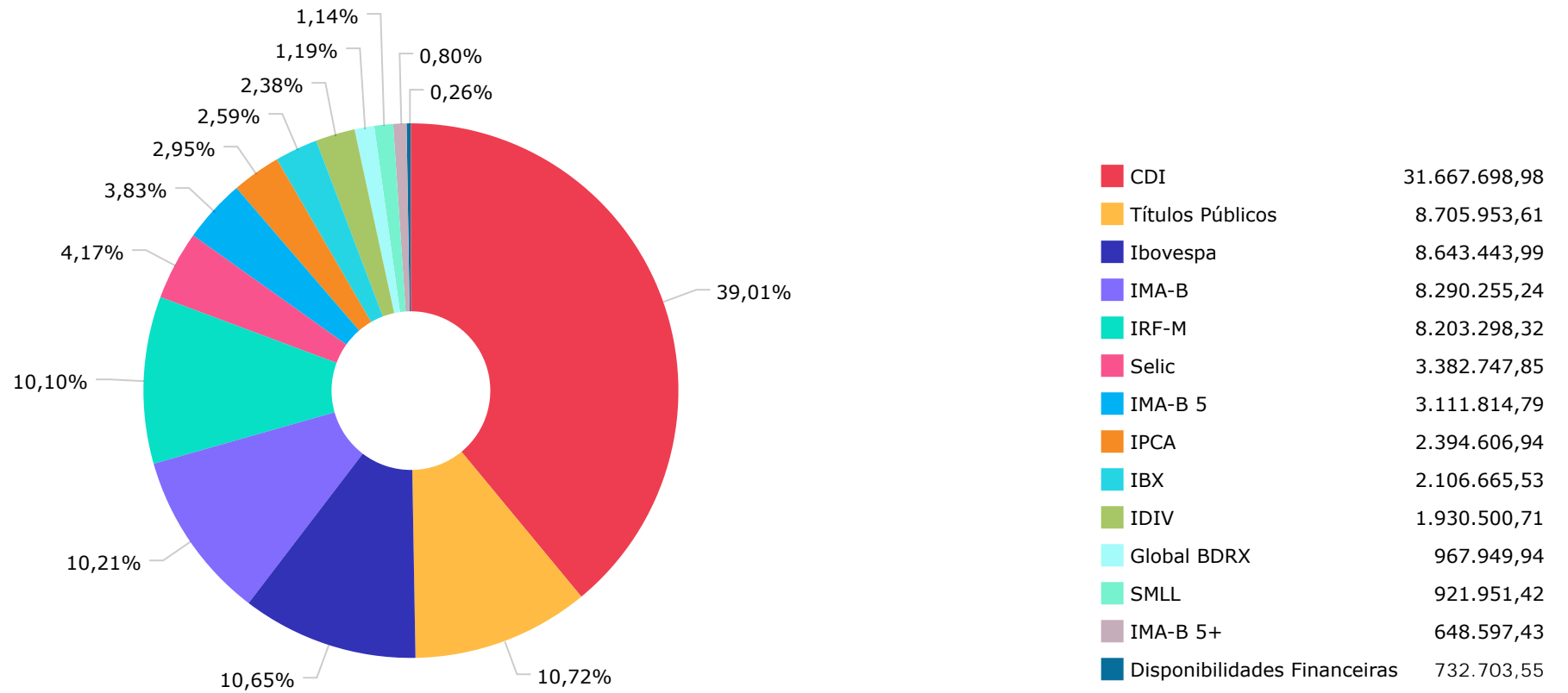


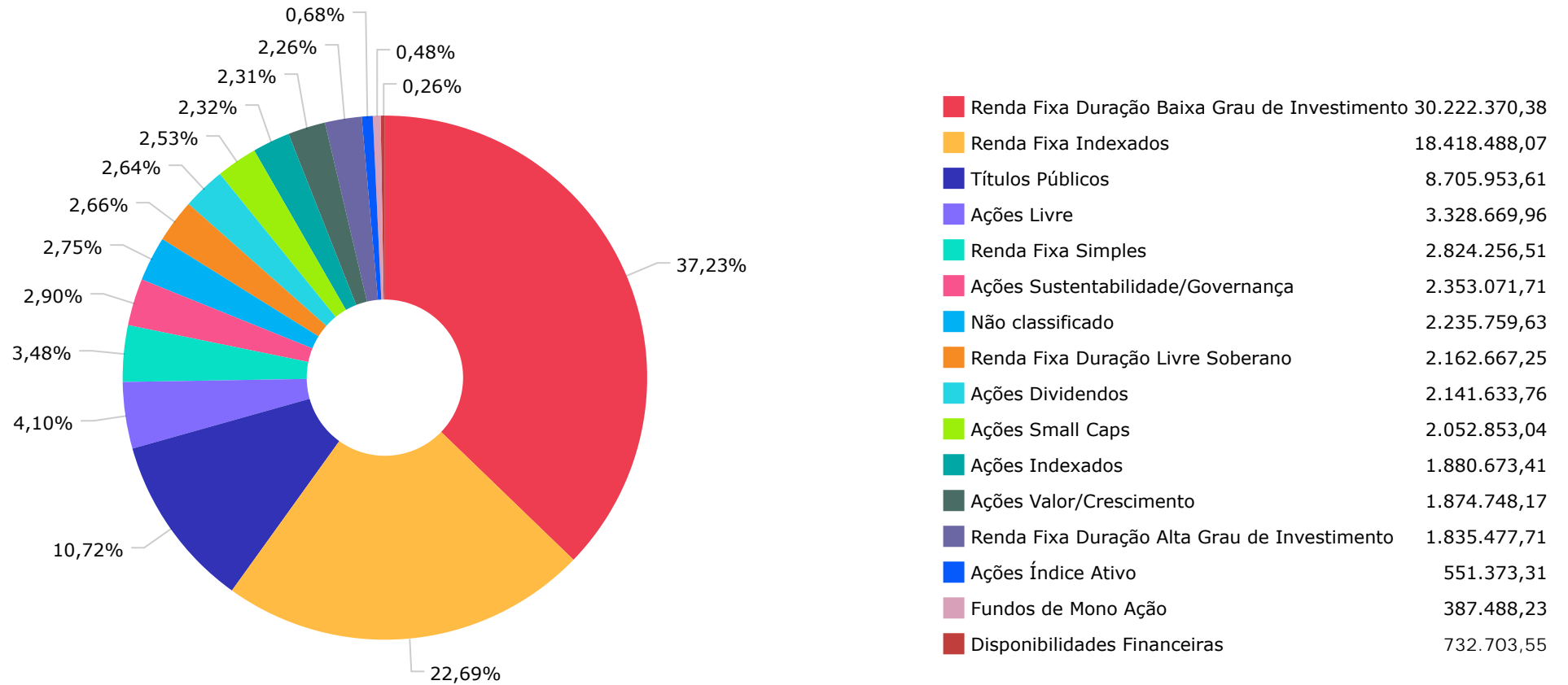
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	10,72%	0,00%	10,00%	100,00%	72.480.577,39	8° I - Fundos de Ações	16,75%	0,00%	17,00%	40,00%	18.872.050,75
7° I b - FI 100% Títulos TN	21,64%	0,00%	19,00%	100,00%	63.614.063,33	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	32.474.612,40
7° III a - FI Referenciados RF	46,96%	0,00%	48,00%	70,00%	18.707.839,76	9° III - Ações - BDR Nível I	1,19%	0,00%	1,00%	10,00%	7.150.703,16
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	16.237.306,20	10° I - Fundos Multimercados	2,47%	0,00%	1,00%	10,00%	6.114.833,16
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.118.653,10	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.059.326,55
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	8.118.653,10						
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	8.118.653,10						

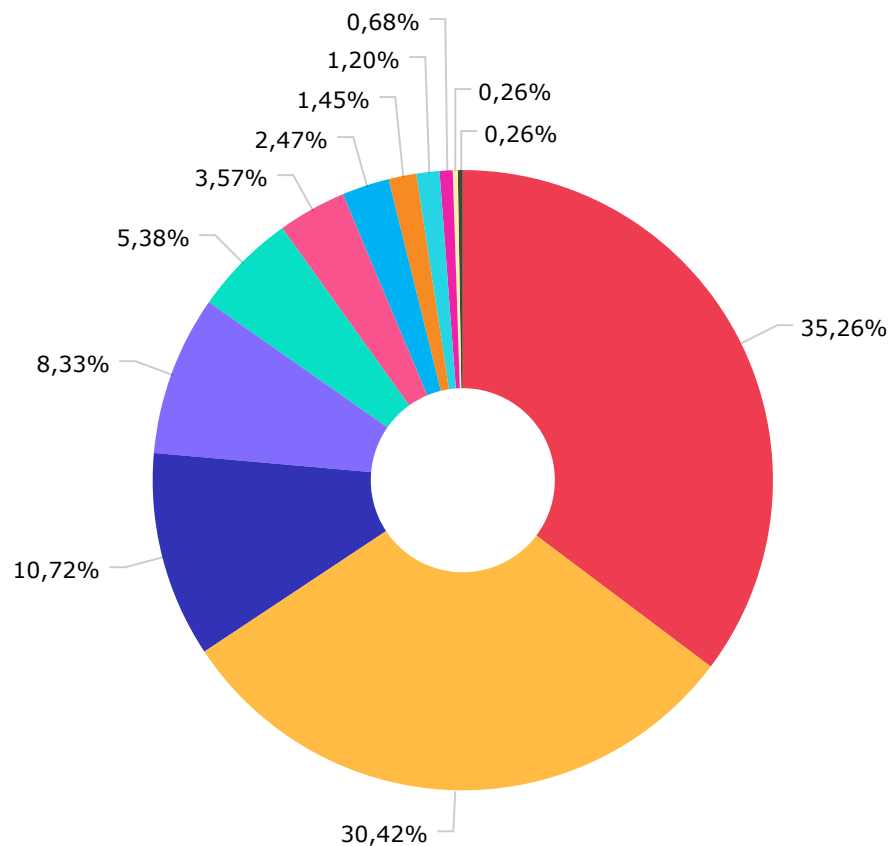
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>CDI - BENCHMARK</b>	<b>0,83</b>	<b>2,62</b>	<b>2,62</b>	<b>5,54</b>	<b>12,36</b>	<b>27,28</b>		
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	3,52	8,92	8,92	19,41	32,36		3,89	8,19
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,86	2,79	2,79	5,80	13,09	28,17	0,02	0,04
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,87	2,72	2,72	5,74	12,93	27,88	0,01	0,03
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,85	2,65	2,65	5,55	12,40	27,30	0,01	0,03
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75	2,38	2,38	5,02	11,27	24,78	0,01	0,02
<b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>	<b>4,04</b>	<b>15,88</b>	<b>15,88</b>	<b>24,88</b>	<b>34,65</b>	<b>30,56</b>		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,48	14,98	14,98	23,77	32,44	27,69	5,89	12,41
<b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>	<b>-0,71</b>	<b>-4,53</b>	<b>-4,53</b>	<b>9,90</b>	<b>25,74</b>	<b>6,76</b>		
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	-7,06	-2,33	-2,33	3,39	72,34	104,47	20,51	43,20
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-0,44	-3,57	-3,57	10,25	25,42	4,21	5,22	10,99
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-0,70	-4,51	-4,51	9,74	25,17	6,73	4,94	10,41
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-0,50	-4,18	-4,18	9,30	24,86	3,40	5,24	11,03
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	-0,89	-3,17	-3,17	9,72	24,55	2,14	5,72	12,04
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,27	-4,27	-4,27	9,48	20,76	-0,83	5,21	10,97
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,83	-4,10	-4,10	7,51	20,05	3,96	4,48	9,43
<b>IBX - BENCHMARK</b>	<b>-0,73</b>	<b>-4,29</b>	<b>-4,29</b>	<b>10,02</b>	<b>25,18</b>	<b>5,09</b>		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2,89	1,36	1,36	10,39	23,62	0,40	4,31	9,08
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-0,11	-5,08	-5,08	4,69	9,20	-19,36	7,83	16,49
<b>IDIV - BENCHMARK</b>	<b>-1,20</b>	<b>-3,81</b>	<b>-3,81</b>	<b>10,25</b>	<b>27,20</b>	<b>19,02</b>		
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-1,01	-2,33	-2,33	10,04	26,45	13,34	4,06	8,56
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,38	-3,11	-3,11	10,84	24,53	10,50	4,71	9,92



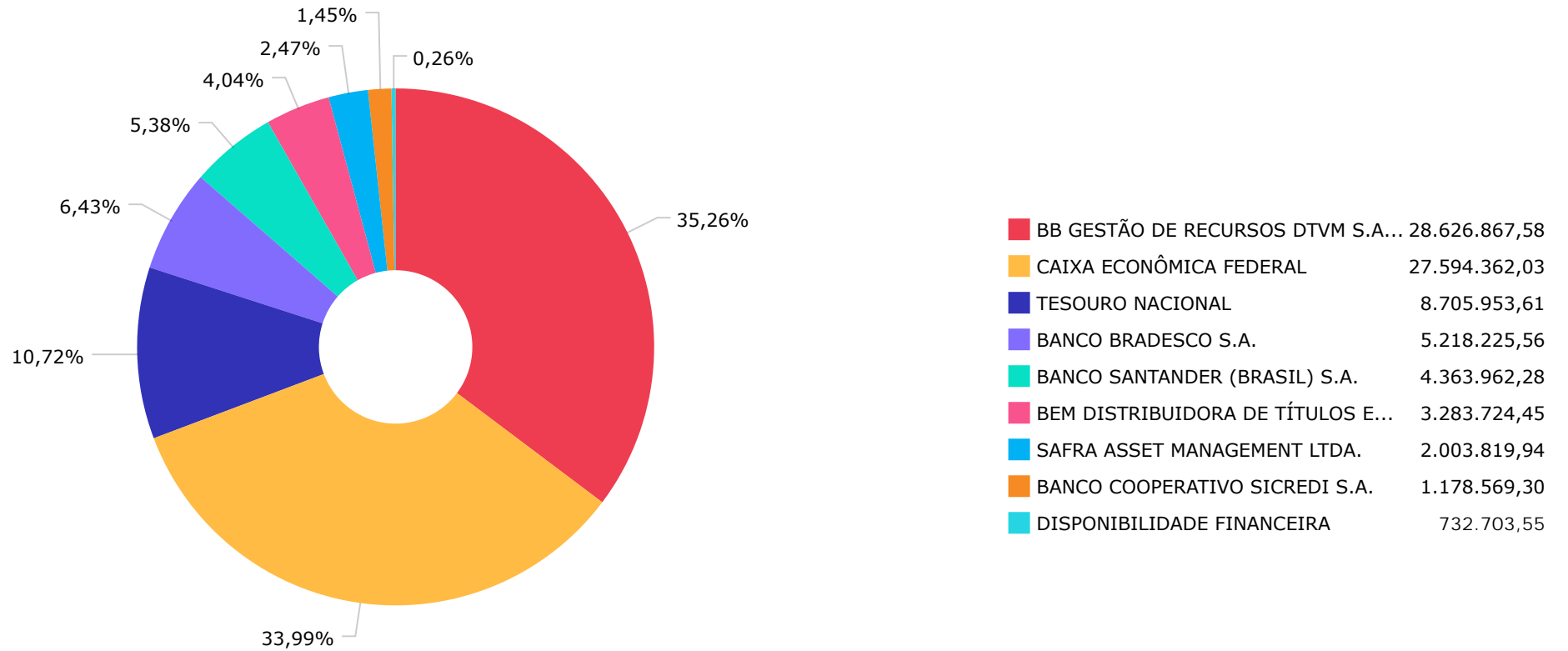
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>IMA-B - BENCHMARK</b>	<b>0,08</b>	<b>0,18</b>	<b>0,18</b>	<b>4,94</b>	<b>11,81</b>	<b>20,21</b>		
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,10	0,20	0,20	4,97	11,90	19,88	1,10	2,31
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,04	0,06	0,06	4,86	11,67	19,79	1,11	2,34
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06	0,11	0,11	4,82	11,56	19,65	1,09	2,29
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	0,05	0,10	0,10	4,80	11,54	19,61	1,08	2,28
<b>IMA-B 5 - BENCHMARK</b>	<b>0,77</b>	<b>2,06</b>	<b>2,06</b>	<b>5,09</b>	<b>9,62</b>	<b>21,01</b>		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,75	2,01	2,01	4,98	9,48	20,72	0,44	0,93
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,74	1,97	1,97	4,93	9,33	20,22	0,44	0,93
<b>IMA-B 5+ - BENCHMARK</b>	<b>-0,55</b>	<b>-1,51</b>	<b>-1,51</b>	<b>4,82</b>	<b>13,38</b>	<b>19,08</b>		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,59	-1,61	-1,61	4,66	13,00	18,25	1,71	3,59
<b>IPCA - BENCHMARK</b>	<b>0,16</b>	<b>1,42</b>	<b>1,42</b>	<b>2,51</b>	<b>3,93</b>	<b>8,76</b>		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92	2,78	2,78	5,01	9,81	20,12	0,20	0,42
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91	2,77	2,77	4,98	9,78	21,57	0,20	0,42
<b>IRF-M - BENCHMARK</b>	<b>0,54</b>	<b>1,68</b>	<b>1,68</b>	<b>6,13</b>	<b>14,03</b>	<b>27,20</b>		
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50	1,61	1,61	6,01	13,79	26,76	0,72	1,51
<b>SELIC - BENCHMARK</b>	<b>0,83</b>	<b>2,62</b>	<b>2,62</b>	<b>5,54</b>	<b>12,36</b>	<b>27,28</b>		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91	2,92	2,92	6,02	13,31	28,84	0,03	0,06
<b>SMLL - BENCHMARK</b>	<b>2,15</b>	<b>-4,09</b>	<b>-4,09</b>	<b>6,93</b>	<b>24,13</b>	<b>-10,57</b>		
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1,78	-4,32	-4,32	5,50	24,72	-12,50	7,22	15,21







BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	28.626.867,58
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	24.693.457,77
TESOURO NACIONAL	8.705.953,61
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	6.763.679,74
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	4.363.962,28
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU...	2.900.904,26
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	2.003.819,94
CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ...	1.178.569,30
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	975.763,91
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	551.373,31
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECU...	211.133,05
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	732.703,55

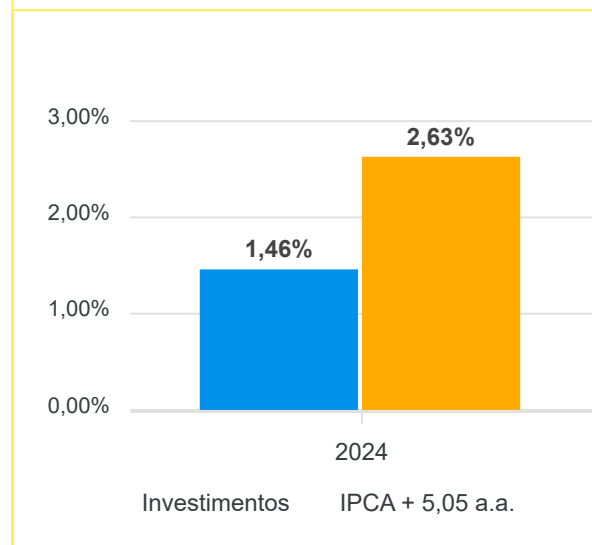


Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	78.915.388,20	610.771,22	334.773,31	79.118.692,45	-72.693,66	-72.693,66	-0,09% ▼	-0,09%	0,85%	0,85%	-10,59%	1,52%
Fevereiro	79.118.692,45	1.071.872,38	806.533,67	80.109.153,08	725.121,92	652.428,26	0,91% ▲	0,82%	1,21%	2,07%	39,61%	1,65%
Março	80.109.153,08	781.814,86	422.656,88	80.975.484,75	507.173,69	1.159.601,95	0,63% ▲	1,46%	0,55%	2,63%	55,51%	1,36%

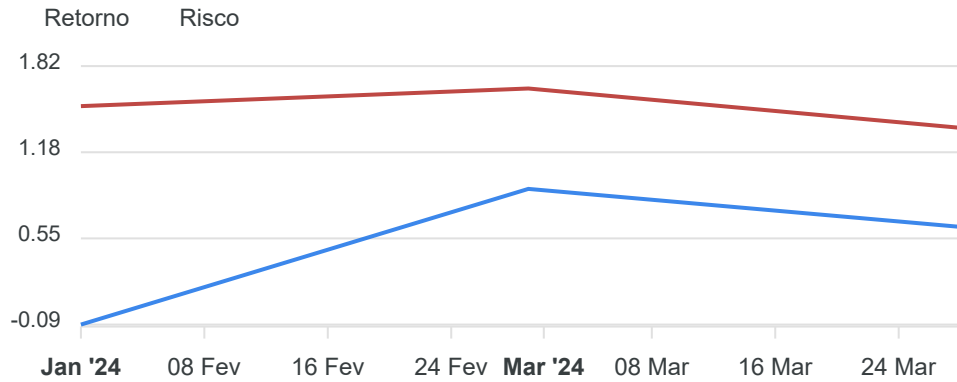
Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	1.159.601,95	1,46%	2,63%

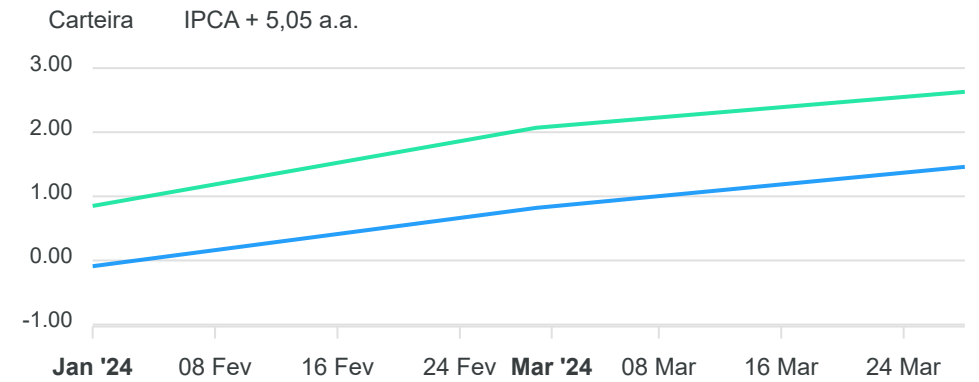
**Gráfico Retorno e Meta Acumulado**



**Gráfico Risco x Retorno**

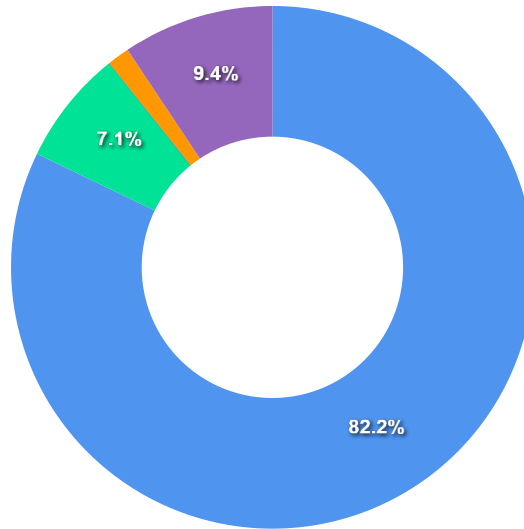


**Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade**



**Liquidez - 28/03/2024**

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	66.695.274,13	82,36
Até D+180	5.785.303,26	7,14
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	1.113.829,11	1,38
Acima D+3600	7.592.124,50	9,38
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	8.620.643,76	0,00	0,00	8.705.953,61	85.309,85	0,99% ▲	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.443.121,45	781.814,86	422.656,88	2.824.256,51	21.977,08	0,68% ▲	0,01%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	652.422,67	0,00	0,00	648.597,43	-3.825,24	-0,59% ▼	1,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.902.466,62	0,00	0,00	2.904.196,86	1.730,24	0,06% ▲	1,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	14.581.090,33	0,00	0,00	14.705.438,54	124.348,21	0,85% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	229.847,43	0,00	0,00	231.939,69	2.092,26	0,91% ▲	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.143.006,09	0,00	0,00	2.162.667,25	19.661,16	0,92% ▲	0,20%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1.822.024,74	0,00	0,00	1.835.477,71	13.452,97	0,74% ▲	0,44%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.352.227,55	0,00	0,00	3.382.747,85	30.520,30	0,91% ▲	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.214.433,33	0,00	0,00	10.303.140,98	88.707,65	0,87% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.266.801,99	0,00	0,00	1.276.337,08	9.535,09	0,75% ▲	0,44%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.162.478,63	0,00	0,00	8.203.298,32	40.819,69	0,50% ▲	0,72%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2.059.981,75	0,00	0,00	2.062.058,04	2.076,29	0,10% ▲	1,10%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2.144.282,08	0,00	0,00	2.145.431,04	1.148,96	0,05% ▲	1,08%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.815.362,40	0,00	0,00	1.831.043,01	15.680,61	0,86% ▲	0,02%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.178.144,20	0,00	0,00	1.178.569,30	425,10	0,04% ▲	1,11%
	63.588.335,02	781.814,86	422.656,88	64.401.153,22	453.660,22	0,71%	0,28%



RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	948.364,08	0,00	0,00	975.763,91	27.399,83	2,89% ▲	4,31%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.879.786,02	0,00	0,00	1.874.748,17	-5.037,85	-0,27% ▼	5,21%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.364.791,57	0,00	0,00	2.353.071,71	-11.719,86	-0,50% ▼	5,24%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	905.806,56	0,00	0,00	921.951,42	16.144,86	1,78% ▲	7,22%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	416.135,13	0,00	0,00	414.552,56	-1.582,57	-0,38% ▼	4,71%
BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.132.147,39	0,00	0,00	1.130.901,62	-1.245,77	-0,11% ▼	7,83%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVSPA FI AÇÕES	1.894.024,45	0,00	0,00	1.880.673,41	-13.351,04	-0,70% ▼	4,94%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.531.400,96	0,00	0,00	1.515.948,15	-15.452,81	-1,01% ▼	4,06%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.391.059,24	0,00	0,00	1.384.956,11	-6.103,13	-0,44% ▼	5,22%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	212.910,12	0,00	0,00	211.133,05	-1.777,07	-0,83% ▼	4,48%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	556.300,23	0,00	0,00	551.373,31	-4.926,92	-0,89% ▼	5,72%
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	416.940,97	0,00	0,00	387.488,23	-29.452,74	-7,06% ▼	20,51%
-	13.649.666,72	0,00	0,00	13.602.561,65	-47.105,07	-0,35%	5,77%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1.935.734,13	0,00	0,00	2.003.819,94	68.085,81	3,52% ▲	3,89%
-	1.935.734,13	0,00	0,00	2.003.819,94	68.085,81	3,52%	3,89%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	935.417,21	0,00	0,00	967.949,94	32.532,73	3,48% ▲	5,89%
	935.417,21	0,00	0,00	967.949,94	32.532,73	3,48%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.485.673,51	2.464.458,46	1.180.943,85	2.824.256,51	55.068,39	1,39% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	659.224,25	0,00	0,00	648.597,43	-10.626,82	-1,61% ▼
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.901.118,35	0,00	0,00	2.904.196,86	3.078,51	0,11% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	14.326.421,01	0,00	0,00	14.705.438,54	379.017,53	2,65% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	232.346,89	0,00	6.763,38	231.939,69	6.356,18	2,74% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.164.213,60	0,00	61.057,38	2.162.667,25	59.511,03	2,75% ▲
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1.800.042,81	0,00	0,00	1.835.477,71	35.434,90	1,97% ▲
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.286.740,48	0,00	0,00	3.382.747,85	96.007,37	2,92% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.030.267,29	0,00	0,00	10.303.140,98	272.873,69	2,72% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.251.231,38	0,00	0,00	1.276.337,08	25.105,70	2,01% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.072.947,41	0,00	0,00	8.203.298,32	130.350,91	1,61% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2.057.987,96	0,00	0,00	2.062.058,04	4.070,08	0,20% ▲
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2.143.195,44	0,00	0,00	2.145.431,04	2.235,60	0,10% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.879.773,47	0,00	100.000,00	1.831.043,01	51.269,54	2,73% ▲
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.177.858,11	0,00	0,00	1.178.569,30	711,19	0,06% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	8.661.179,35	0,00	215.199,25	8.705.953,61	259.973,51	3,00% ▲
	62.130.221,31	2.464.458,46	1.563.963,86	64.401.153,22	1.370.437,31	2,17%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	962.670,39	0,00	0,00	975.763,91	13.093,52	1,36% ▲
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.958.300,94	0,00	0,00	1.874.748,17	-83.552,77	-4,27% ▼
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.455.784,77	0,00	0,00	2.353.071,71	-102.713,06	-4,18% ▼
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	963.555,48	0,00	0,00	921.951,42	-41.604,06	-4,32% ▼
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	427.860,40	0,00	0,00	414.552,56	-13.307,84	-3,11% ▼
BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.191.412,68	0,00	0,00	1.130.901,62	-60.511,06	-5,08% ▼
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESA FI AÇÕES	1.969.464,17	0,00	0,00	1.880.673,41	-88.790,76	-4,51% ▼
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.552.049,80	0,00	0,00	1.515.948,15	-36.101,65	-2,33% ▼
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.436.254,30	0,00	0,00	1.384.956,11	-51.298,19	-3,57% ▼
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	220.169,44	0,00	0,00	211.133,05	-9.036,39	-4,10% ▼
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	569.433,80	0,00	0,00	551.373,31	-18.060,49	-3,17% ▼
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	396.731,33	0,00	0,00	387.488,23	-9.243,10	-2,33% ▼
	<b>14.103.687,50</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>13.602.561,65</b>	<b>-501.125,85</b>	<b>-3,55%</b>

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1.839.644,66	0,00	0,00	2.003.819,94	164.175,28	8,92% ▲
	1.839.644,66	0,00	0,00	2.003.819,94	164.175,28	8,92%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	841.834,73	0,00	0,00	967.949,94	126.115,21	14,98% ▲
	841.834,73	0,00	0,00	967.949,94	126.115,21	14,98%

## Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **IMPREV INST MUNC PREV VIRADOURO - SP** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Março/2024**, atestando os dados relativos à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.



## Aprovação do Conselho Fiscal

O Conselho Fiscal do **IMPREV INST MUNC PREV VIRADOURO - SP** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Março/2024** bem como o parecer do Comitê de Investimentos, que tratam do acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do **IMPREV INST MUNC PREV VIRADOURO - SP** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

