

2024

Relatório Mensal

Novembro

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	19.681.334,76	19,09%	5.659.641.883,51	0,35%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.654.576,80	9,37%	4.812.833.118,29	0,20%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.513.619,82	11,17%	8.272.095.859,24	0,14%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	11.311.132,28	10,97%	3.870.114.354,02	0,29%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.743.142,77	3,63%	1.256.608.616,06	0,30%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.187.877,45	4,06%	924.145.523,01	0,45%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.449.575,80	5,29%	3.188.944.783,21	0,17%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	17.024.523,41	16,52%	4.217.186.353,15	0,40%	7º III a
BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.024.259,15	2,93%	15.384.948.340,63	0,02%	7º III a
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	83.912,38	0,08%	1.096.323,78	7,65%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.041.848,65	2,95%	7.327.212.030,68	0,04%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1.954.094,77	1,90%	2.152.693.853,65	0,09%	7º III a
BB AGRO FIC AÇÕES	524.864,65	0,51%	189.702.727,27	0,28%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.010.027,02	0,98%	769.668.398,45	0,13%	8º I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.526.830,57	2,45%	603.693.249,12	0,42%	8º I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.448.873,11	2,38%	1.002.275.983,06	0,24%	8º I
MAG BRASIL FI AÇÕES	4.265.652,92	4,14%	272.154.196,98	1,57%	8º I
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL 1	845.755,09	0,82%	260.902.451,40	0,32%	9º III
AUSTRO MULTISSETORIAL FIP MULTIESTRATÉGIA	313.146,22	0,30%	0,00		10º II
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	190.639,04	0,18%	4.655.686,41	4,09%	10º II
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	52.058,80	0,05%	107.124.902,59	0,05%	10º II
PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA	10.674,80	0,01%	3.595.985,63	0,30%	10º II
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	224.000,00	0,22%	50.077.886,60	0,45%	11º

Investimentos

\$ 103.082.420,26

Disponibilidades Financeiras

\$ 128.151,12

Total Carteira

\$ 103.210.571,38

Governança (Pró Gestão)

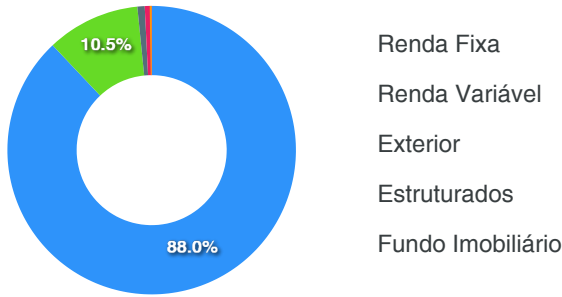
NIVEL 1 09/12/2025

Artigos	Limite (%)	Utilizado		Livre	
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	63,58%	65.541.259,68	36,42%	37.541.160,58
7º III a - FI Referenciados RF	65,00%	24,38%	25.128.638,36	40,62%	41.874.934,81
8º I - Fundos de Ações	35,00%	10,45%	10.776.248,27	24,55%	25.302.598,82
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,82%	845.755,09	9,18%	9.462.486,94
10º II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	0,55%	566.518,86	4,45%	4.587.602,15
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,22%	224.000,00	4,78%	4.930.121,01

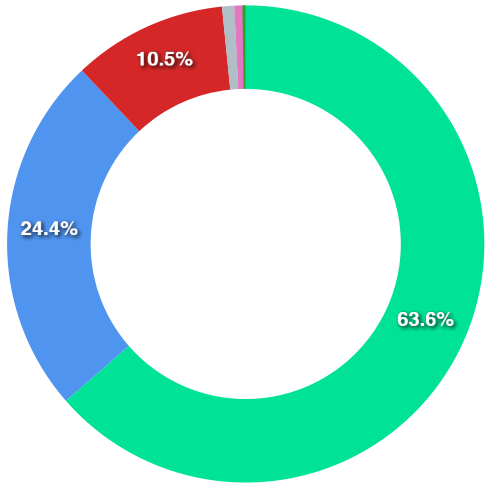
Governança (Pró Gestão)

🔗 NIVEL 1 09/12/2025

Segmentos



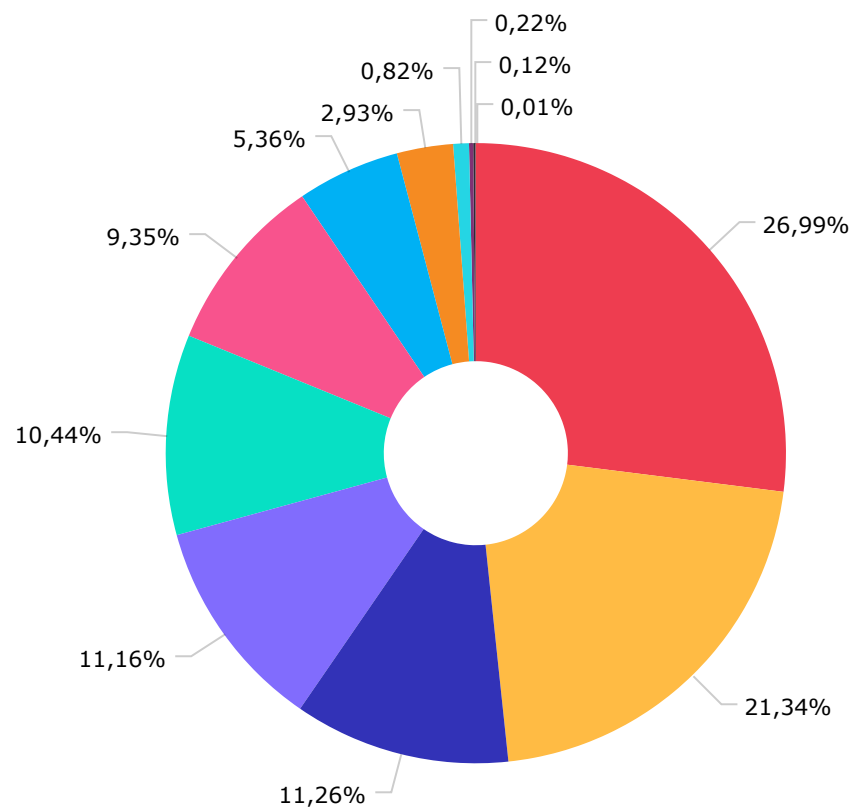
Artigos



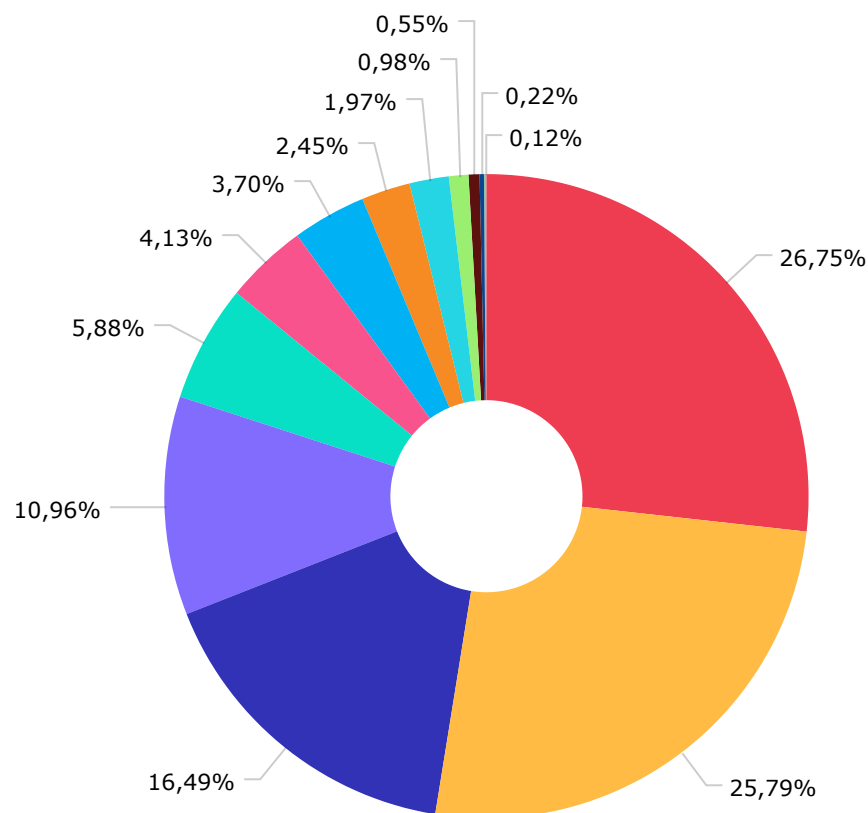
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	103.082.420,26	8º I - Fundos de Ações	10,45%	0,00%	15,00%	35,00%	25.302.598,82
7º I b - FI 100% Títulos TN	63,58%	0,00%	63,00%	100,00%	37.541.160,58	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	35,00%	36.078.847,09
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	103.082.420,26	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	10.308.242,03
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.154.121,01	9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	10.308.242,03
7º III a - FI Referenciados RF	24,38%	0,00%	15,00%	65,00%	41.874.934,81	9º III - Ações - BDR Nível I	0,82%	0,00%	1,00%	10,00%	9.462.486,94
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	67.003.573,17	10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	10.308.242,03
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	20.616.484,05	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,55%	0,00%	0,00%	5,00%	4.587.602,15
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.154.121,01	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.154.121,01
7º V b - Fundos de RF - Crêdit...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.154.121,01	11º - Fundos Imobiliários	0,22%	0,00%	1,00%	5,00%	4.930.121,01
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.154.121,01	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.154.121,01

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	0,40		1,80	3,34			1,08	2,28
AUSTRO MULTISSETORIAL FIP MULTISTRATÉGIA								
CDI - BENCHMARK								
	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58		
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,80	10,24	2,61	5,36	11,29	26,61	0,01	0,03
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,82	9,93	2,85	5,53	11,17	25,30	0,10	0,22
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,72	8,88	2,34	4,73	9,78	23,13	0,01	0,02
GLOBAL BDRX - BENCHMARK								
	8,32	63,02	14,60	30,35	67,66	97,27		
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL 1	9,14	55,22	15,11	29,56	58,42	64,26	8,11	17,09
IBOVESPA - BENCHMARK								
	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72		
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,85	-2,63	-4,98	4,54	5,29	22,92	8,35	17,59
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-3,05	-5,99	-7,72	2,60	-0,80	10,06	8,17	17,21
MAG BRASIL FI AÇÕES	-3,26	-7,88	-7,97	2,08	-2,76	2,10	8,09	17,04
BB AGRO FIC AÇÕES	-1,08	-7,53	-6,34	1,25	-3,72	-0,31	10,27	21,63
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,46	-10,83	-6,48	2,21	-6,18	3,33	6,10	12,84
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK								
	0,22	6,09	1,42	2,97	7,63	20,43		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31	6,24	1,61	3,30	7,75	20,15	1,08	2,26
IMA-B - BENCHMARK								
	0,02	0,19	-1,29	0,32	2,94	16,04		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	-0,06	-1,37	0,18	2,67	15,52	2,97	6,26
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-4,32	-34,11	-11,65	-20,42	-35,60	-54,47	1,43	3,01
IPCA - BENCHMARK								
	0,39	4,29	1,40	1,98	4,87	9,78		

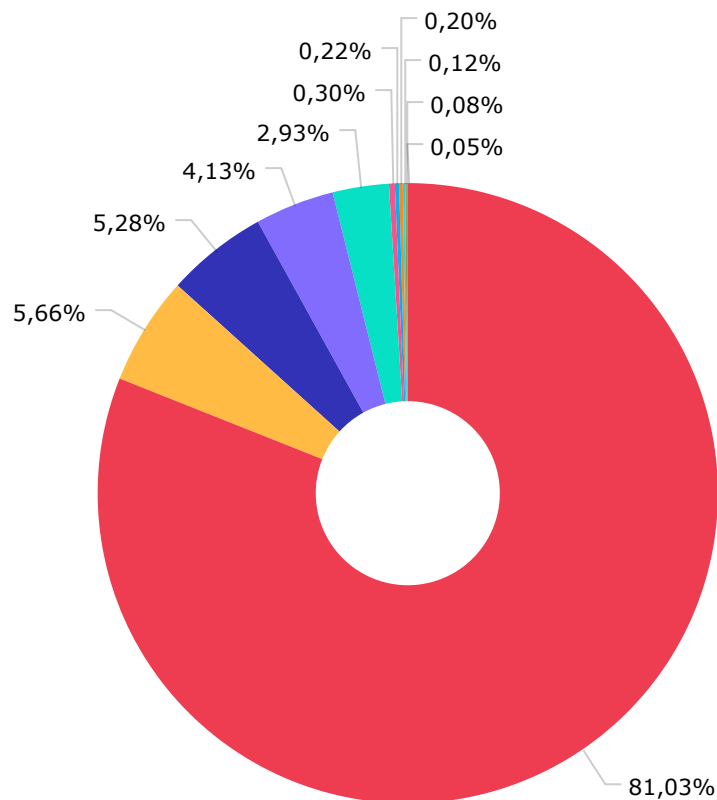
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45	7,94	1,92	4,35	8,96	25,07	0,43	0,91
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,12	4,71	1,09	2,67	6,49	19,38	1,20	2,53
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,28	0,28	-1,30	0,39	2,60	15,76	2,51	5,28
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,06	-0,69	-0,18	-0,37	-0,75	-1,51		
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	-6,02	-16,54	-6,57	-7,36	-16,85	-22,74		
IPCA + 8,00% AO ANO - BENCHMARK	0,97	11,95	3,37	5,98	13,26	28,05		
PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,09	-1,52	-0,30	-0,61	-1,61	-3,35		
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,57	8,70	2,25	4,67	9,69	24,55		
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54	8,44	2,18	4,50	9,40	23,83	0,22	0,47
SELIC - BENCHMARK	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58		
BRABESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,81	10,56	2,64	5,49	11,60	27,09	0,01	0,03
IFIX - BENCHMARK	-2,11	-5,26	-7,55	-7,24	-1,23	9,42		
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-2,78	2,19	-14,63	-24,73	-0,71	-56,52		



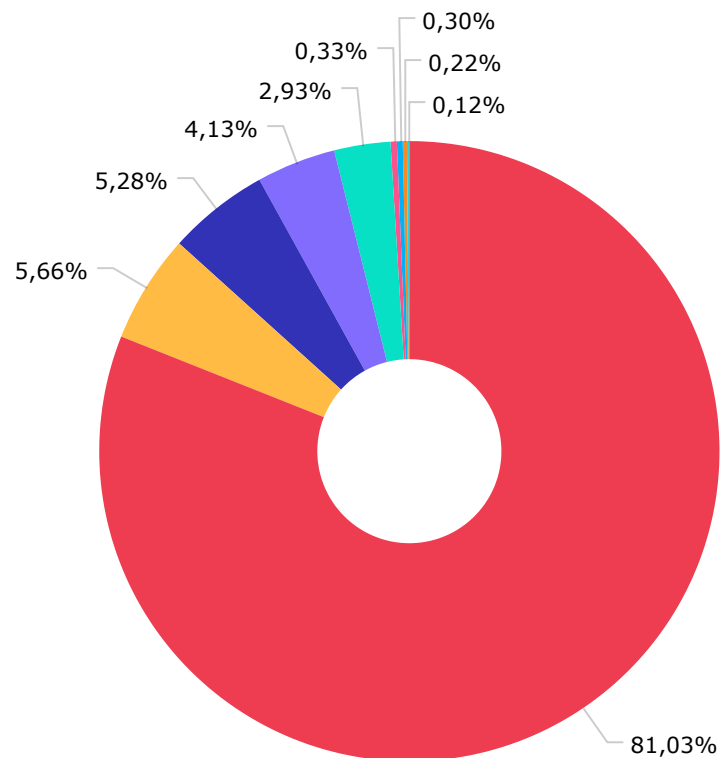
IPCA	27.855.052,82
CDI	22.020.466,83
Não definido	11.624.278,50
IRF-M 1	11.513.619,82
Ibovespa	10.776.248,27
IDKA IPCA 2 Anos	9.654.576,80
IMA-B	5.533.488,18
Selic	3.024.259,15
Global BDRX	845.755,09
IFIX	224.000,00
Disponibilidades Financeiras	128.151,12
IPCA + 8,00% ao ano	10.674,80



Renda Fixa Duração Livre Soberano	27.612.354,98
Renda Fixa Indexados	26.617.772,42
Renda Fixa Simples	17.024.523,41
Não classificado	11.311.132,28
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	6.066.107,80
Ações Índice Ativo	4.265.652,92
Ações Livre	3.819.492,85
Ações Sustentabilidade/Governança	2.526.830,57
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	2.038.007,15
Ações Dividendos	1.010.027,02
Fundos de Participações	566.518,86
FII Renda Gestão Ativa	224.000,00
Disponibilidades Financeiras	128.151,12



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	83.626.802,64
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT...	5.841.698,51
CAIXA DTVM	5.449.575,80
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS L...	4.265.652,92
BANCO BRADESCO S.A.	3.024.259,15
RENTA ASSET ADMINISTRADORA DE ...	313.146,22
ZION GESTÃO DE RECURSOS LTDA	224.000,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.	201.313,84
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	128.151,12
VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA	83.912,38
RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL...	52.058,80



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	83.626.802,64
ITAU UNIBANCO S.A.	5.841.698,51
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.449.575,80
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	4.265.652,92
BANCO BRADESCO S.A.	3.024.259,15
RJI CORRETORA DE TÍTULOS E VAL...	337.285,02
BFL ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS ...	313.146,22
PLANNER TRUSTEE DTVM LTDA.	224.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	128.151,12

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	95.031.819,30	1.796.432,83	762.106,99	96.038.562,16	-27.582,98	-27.582,98	-0,03% ▼	-0,03%	1,01%	1,01%	-2,97%	1,19%
Fevereiro	96.038.562,16	1.740.808,57	2.019.531,97	96.410.437,03	650.598,27	623.015,29	0,68% ▲	0,65%	1,19%	2,21%	29,41%	1,21%
Março	96.410.437,03	1.149.614,15	804.906,52	97.277.474,81	522.330,15	1.145.345,44	0,54% ▲	1,19%	0,59%	2,81%	42,35%	0,99%
Abril	97.277.474,81	1.356.121,14	736.000,41	97.449.880,98	-447.714,56	697.630,88	-0,46% ▼	0,73%	0,81%	3,64%	20,05%	1,41%
Maiο	97.449.880,98	1.226.310,31	856.723,09	98.325.029,44	505.561,24	1.203.192,12	0,52% ▲	1,25%	0,88%	4,55%	27,47%	1,18%
Junho	98.325.029,44	12.372.510,60	12.111.741,73	98.960.258,52	374.460,21	1.577.652,33	0,38% ▲	1,63%	0,65%	5,22%	31,23%	1,57%
Julho	98.960.258,52	1.132.788,51	762.464,57	100.671.537,23	1.340.954,77	2.918.607,10	1,35% ▲	3,01%	0,72%	5,98%	50,33%	1,44%
Agosto	100.671.537,23	21.047.725,69	21.768.090,64	101.263.767,65	1.312.595,37	4.231.202,47	1,30% ▲	4,35%	0,29%	6,29%	69,16%	1,68%
Setembro	101.263.767,65	19.967.736,85	19.463.580,97	101.705.554,76	-62.368,77	4.168.833,70	-0,06% ▼	4,29%	0,90%	7,24%	59,25%	1,15%
Outubro	101.705.554,76	7.146.799,06	6.755.207,52	102.559.095,54	461.949,24	4.630.782,94	0,45% ▲	4,76%	1,07%	8,39%	56,73%	1,05%
Novembro	102.559.095,54	1.249.422,13	871.361,50	103.082.420,26	145.264,09	4.776.047,03	0,14% ▲	4,91%	0,71%	9,15%	53,66%	1,51%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	1.145.345,44	1,19%	2,81%
2º Trim	432.306,89	0,44%	2,35%
1º Sem	1.577.652,33	1,63%	5,22%
3º Trim	2.591.181,37	2,61%	1,92%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

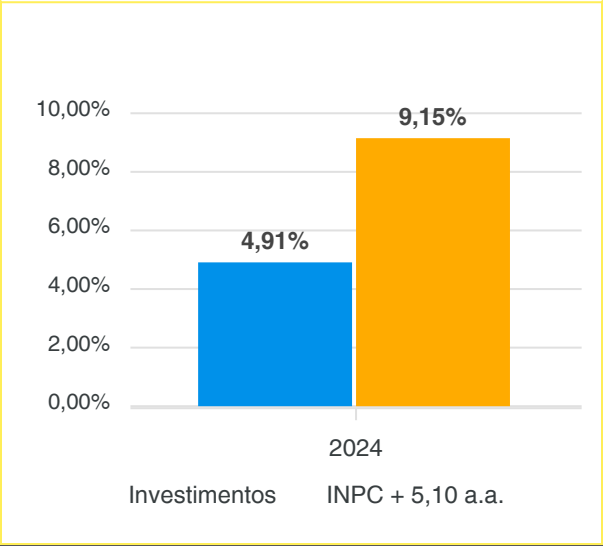
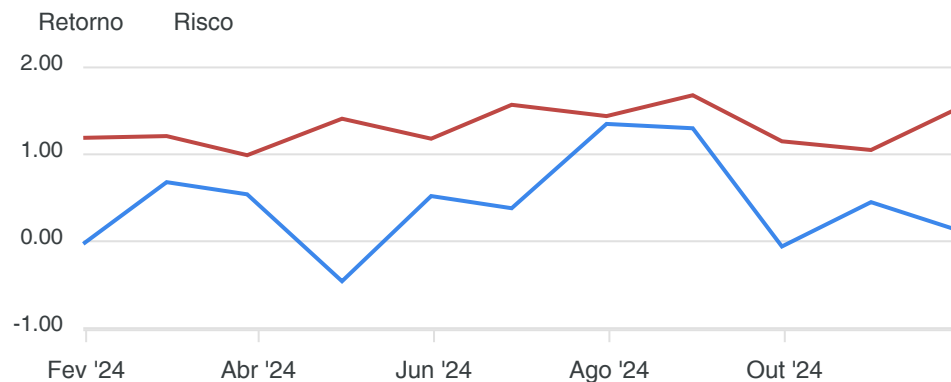
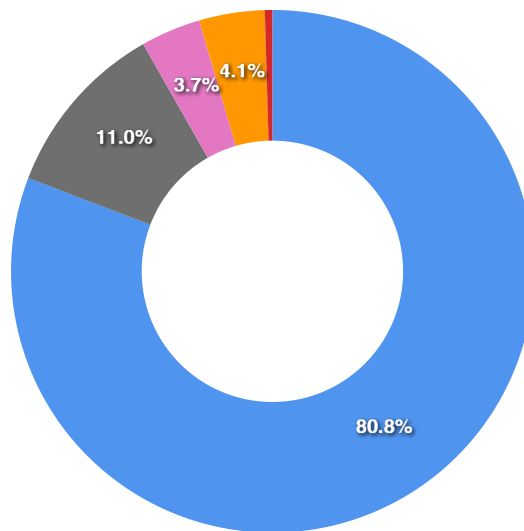


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 29/11/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	83.407.133,86	80,81
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	11.311.132,28	10,96
Até D+1800	3.827.055,15	3,71
Até D+3600	4.187.877,45	4,06
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	477.372,64	0,46



RENTA FIJA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	19.592.207,09	0,00	0,00	19.681.334,76	89.127,67	0,45% ▲	0,43%
BB FLUXO FIC RENTA FIJA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	16.419.284,45	1.249.422,13	766.124,20	17.024.523,41	121.941,03	0,69% ▲	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	9.624.324,46	0,00	0,00	9.654.576,80	30.252,34	0,31% ▲	1,08%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	11.451.239,47	0,00	0,00	11.513.619,82	62.380,35	0,54% ▲	0,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO...	11.265.599,67	0,00	0,00	11.311.132,28	45.532,61	0,40% ▲	1,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	3.843.556,57	0,00	105.237,30	3.743.142,77	4.823,50	0,13% ▲	1,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	4.199.569,94	0,00	0,00	4.187.877,45	-11.692,49	-0,28% ▼	2,51%
BRANESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENTA FIJA REFERENCIADO DI	3.000.000,00	0,00	0,00	3.024.259,15	24.259,15	0,81% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	5.449.603,82	0,00	0,00	5.449.575,80	-28,02	0,00% ▼	2,97%
IMA-B 1000 FIC RENTA FIJA LP	87.702,65	0,00	0,00	83.912,38	-3.790,27	-4,32% ▼	1,43%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	3.017.765,23	0,00	0,00	3.041.848,65	24.083,42	0,80% ▲	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENTA FIJA LP	1.938.107,99	0,00	0,00	1.954.094,77	15.986,78	0,82% ▲	0,10%
	89.888.961,34	1.249.422,13	871.361,50	90.669.898,04	402.876,07	0,45%	0,72%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AGRO FIC AÇÕES	530.601,58	0,00	0,00	524.864,65	-5.736,93	-1,08% ▼	10,27%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.029.097,26	0,00	0,00	1.010.027,02	-19.070,24	-1,85% ▼	8,35%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.606.430,17	0,00	0,00	2.526.830,57	-79.599,60	-3,05% ▼	8,17%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.510.557,54	0,00	0,00	2.448.873,11	-61.684,43	-2,46% ▼	6,10%
MAG BRASIL FI AÇÕES	4.409.380,11	0,00	0,00	4.265.652,92	-143.727,19	-3,26% ▼	8,09%
-	11.086.066,66	0,00	0,00	10.776.248,27	-309.818,39	-2,79%	7,79%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AUSTRO MULTISETORIAL FIP MULTIESTRATÉGIA	313.146,22	0,00	0,00	313.146,22	0,00	0,00%	-
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	202.854,10	0,00	0,00	190.639,04	-12.215,06	-6,02% ▼	-
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	52.090,62	0,00	0,00	52.058,80	-31,82	-0,06% ▼	-
PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA	10.684,46	0,00	0,00	10.674,80	-9,66	-0,09% ▼	-
-	578.775,40	0,00	0,00	566.518,86	-12.256,54	-2,12%	0,00%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	230.400,00	0,00	0,00	224.000,00	-6.400,00	-2,78% ▼	-
-	230.400,00	0,00	0,00	224.000,00	-6.400,00	-2,78%	0,00%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL 1	774.892,14	0,00	0,00	845.755,09	70.862,95	9,14% ▲	8,11%
	774.892,14	0,00	0,00	845.755,09	70.862,95	9,14%	0,00%

Cenário Econômico

Seguindo a tendência dos últimos meses, novembro foi novamente marcado por muita volatilidade, o que impactou diretamente a rentabilidade dos ativos das carteiras. Na renda fixa, os resultados foram mistos: enquanto os ativos de inflação de longo prazo fecharam em baixa devido à abertura da curva de juros, os ativos de curto prazo tiveram um desempenho positivo. Já a renda variável registrou mais um mês de resultados negativos. No entanto, os ativos ligados a índices no exterior mantiveram um bom desempenho e fecharam o mês no positivo, beneficiados pelo bom desempenho dos ativos externos e pela valorização do dólar frente ao real.

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, demonstraram de forma consolidada e no período resultados ainda insatisfatórios.

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 investimentos presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização, estão presentes na lista exaustiva de instituições com as quais os RPPS podem manter investimentos, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

Como já dissemos, o mês de novembro foi novamente marcado por muita volatilidade, o que impactou diretamente a rentabilidade dos investimentos. Na renda fixa, os ativos de inflação de longo prazo fecharam em baixa devido à abertura da curva de juros, já os ativos de curto prazo tiveram um desempenho positivo. Na renda variável tivemos mais um mês de resultados negativos, ainda basicamente em função das perspectivas tímidas de ajuste fiscal por parte do Governo. Já os ativos ligados a índices no exterior mantiveram um bom desempenho no mês, beneficiados basicamente pela valorização do dólar frente ao real.

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, 11 de dezembro de 2024.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **PREVIBARRAS PREVID SOCIAL DO MUNIC DE QUATRO BARRAS - PR** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Novembro/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 **PREVIBARRAS PREVID SOCIAL DO MUNIC DE QUATRO BARRAS - PR** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Novembro/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 **PREVIBARRAS PREVID SOCIAL DO MUNIC DE QUATRO BARRAS - PR** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

