

2024

Relatório Mensal

Fevereiro

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 IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 3.711.428,69 | 6,62% | 5.237.322.277,24 | 0,07% | 7º I b |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.547.585,29 | 2,76% | 4.190.498.364,43 | 0,04% | 7º I b |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 13.682.209,40 | 24,39% | 597.977.709,89 | 2,29% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 554.802,59 | 0,99% | 494.235.904,87 | 0,11% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 8.516.801,27 | 15,18% | 5.113.275.189,23 | 0,17% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3.169.245,98 | 5,65% | 1.367.941.121,80 | 0,23% | 7º I b |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I | 4.775.496,25 | 8,51% | 1.502.463.249,65 | 0,32% | 7º I b |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES | 319.315,70 | 0,57% | 41.348.083.232,03 | 0,00% | 7º I b |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA | 151.772,32 | 0,27% | 160.265.560,17 | 0,09% | 7º III a |
| BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 4.210.210,31 | 7,51% | 10.050.564.520,10 | 0,04% | 7º III a |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 6.027.072,80 | 10,74% | 455.679.048,91 | 1,32% | 7º III a |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1 | 96.584,86 | 0,17% | 29.236.022,33 | 0,33% | 7º V a |
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES | 3.970.601,78 | 7,08% | 224.683.266,17 | 1,77% | 8º I |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 614.184,98 | 1,09% | 432.411.420,23 | 0,14% | 8º I |
| PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES | 605.772,74 | 1,08% | 277.609.814,22 | 0,22% | 8º I |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | 2.774.476,66 | 4,95% | 322.128.882,98 | 0,86% | 8º I |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 1.370.933,60 | 2,44% | 2.238.336.630,68 | 0,06% | 9º III |

Investimentos

\$ 56.098.495,22

Disponibilidades Financeiras

\$ 122.784,40

Total Carteira

\$ 56.221.279,62

Governança (Pró Gestão)

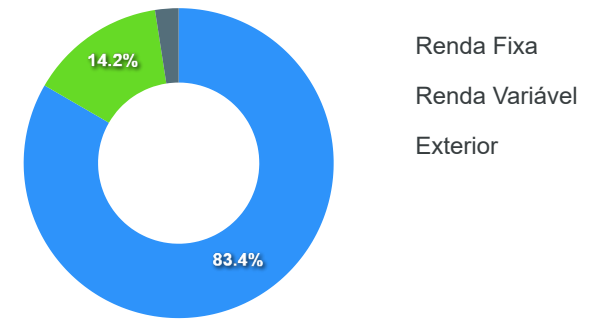
📄 NIVEL 1 29/05/2026

| Artigos | Limite (%) | Utilizado | Livre |
|--------------------------------|------------|-------------------------|-------------------------|
| 7º I b - FI 100% Títulos TN | 100,00% | 64,67% 36.276.885,17 | 35,33% 19.821.610,05 |
| 7º III a - FI Referenciados RF | 65,00% | 18,52% 10.389.055,43 | 46,48% 26.074.966,46 |
| 7º V a - FIDC Cota Sênior | 5,00% | 0,17% 96.584,86 | 4,83% 2.708.339,90 |
| 8º I - Fundos de Ações | 35,00% | 14,20% 7.965.036,16 | 20,80% 11.669.437,17 |
| 9º III - Ações - BDR Nível I | 10,00% | 2,44% 1.370.933,60 | 7,56% 4.238.915,92 |

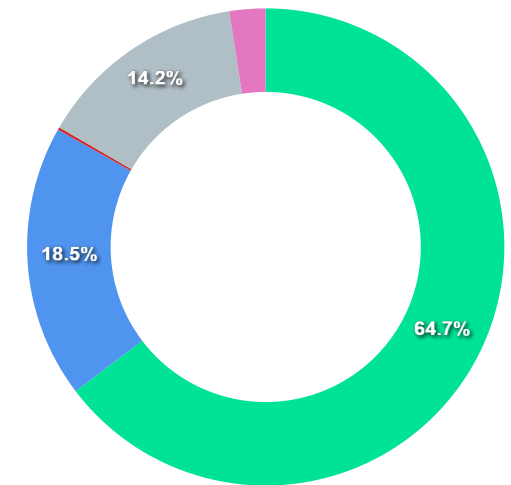
Governança (Pró Gestão)

🔗 NIVEL 1 29/05/2026

Segmentos



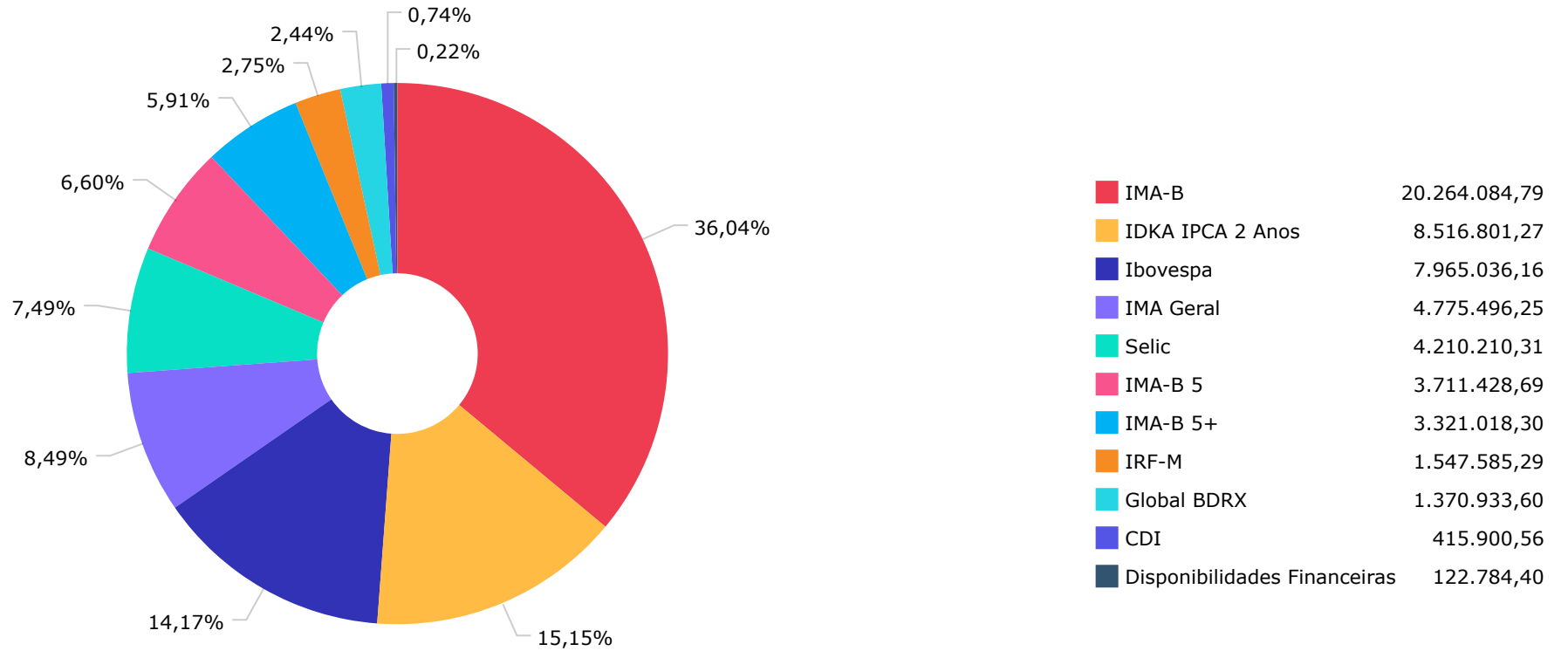
Artigos

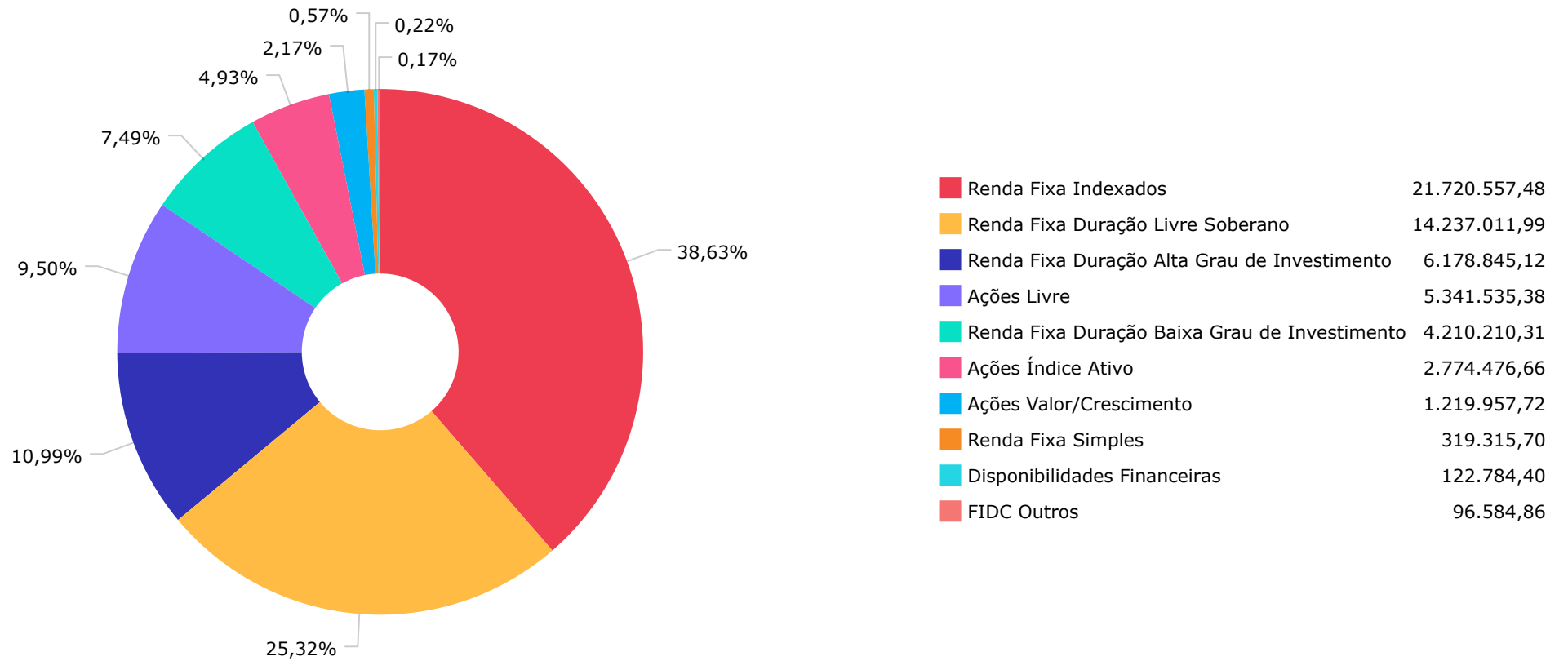


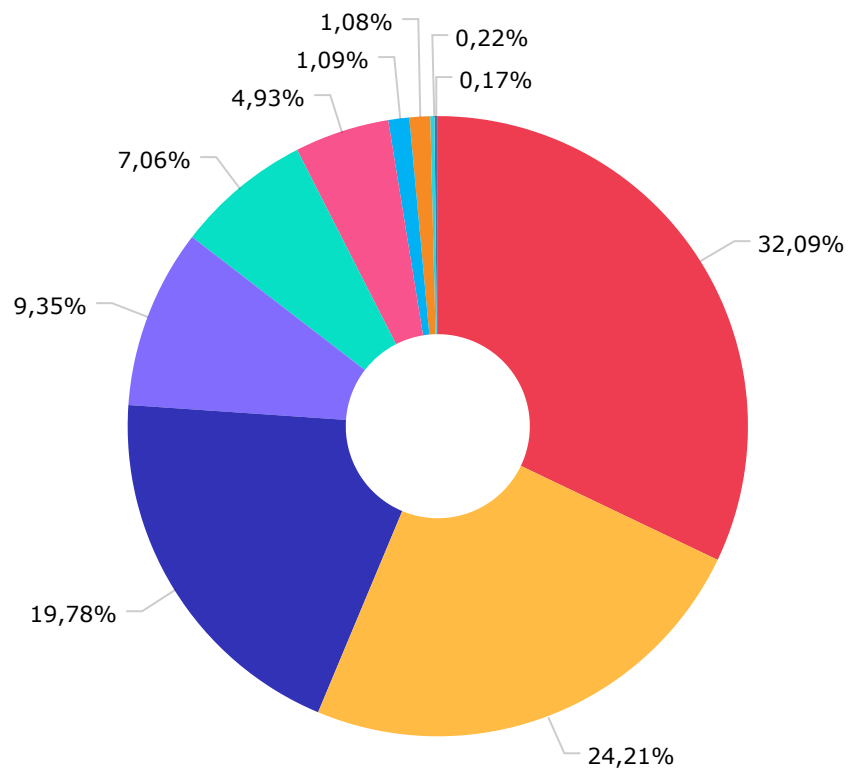
| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior | Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|---------------|------------------------------|--------|----------|--------|----------|---------------|
| 7° I a - Títulos TN SELIC | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 100,00% | 56.098.495,22 | 8° I - Fundos de Ações | 14,20% | 0,00% | 15,00% | 35,00% | 11.669.437,17 |
| 7° I b - FI 100% Títulos TN | 64,67% | 0,00% | 54,00% | 100,00% | 19.821.610,05 | 8° II - ETF de Ações | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 35,00% | 19.634.473,33 |
| 7° III a - FI Referenciados RF | 18,52% | 0,00% | 20,00% | 65,00% | 26.074.966,46 | 9° III - Ações - BDR Nível I | 2,44% | 0,00% | 2,00% | 10,00% | 4.238.915,92 |
| 7° IV - Ativos Financeiros de ... | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 20,00% | 11.219.699,04 | 10° I - Fundos Multimercados | 0,00% | 0,00% | 2,00% | 10,00% | 5.609.849,52 |
| 7° V a - FIDC Cota Sênior | 0,17% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 2.708.339,90 | 11° - Fundos Imobiliários | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 2.804.924,76 |
| 7° V b - Fundos de RF - Crédit... | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 2.804.924,76 | | | | | | |
| 7° V c - Fundos de Debentures ... | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 2.804.924,76 | | | | | | |

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|--|-------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| CDI - BENCHMARK | 0,80 | 1,78 | 2,69 | 5,69 | 12,74 | 27,40 | | |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES | 0,80 | 1,77 | 2,67 | 5,63 | 12,64 | 27,16 | 0,00 | 0,01 |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1 | -0,18 | -0,93 | -1,41 | -6,97 | -15,09 | -61,85 | 0,63 | 1,32 |
| GLOBAL BDRX - BENCHMARK | 6,30 | 11,38 | 14,54 | 15,88 | 33,29 | 20,49 | | |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 6,27 | 11,12 | 13,99 | 15,34 | 32,07 | 18,33 | 8,72 | 18,36 |
| IBOVESPA - BENCHMARK | 0,99 | -3,85 | 1,33 | 11,47 | 22,96 | 14,03 | | |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 2,79 | -2,75 | 3,51 | 11,84 | 28,03 | 19,72 | 7,70 | 16,22 |
| PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES | 0,96 | -2,01 | 2,11 | 12,06 | 23,81 | 31,04 | 6,13 | 12,90 |
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES | 1,86 | 0,11 | 5,57 | 12,27 | 21,32 | 9,02 | 6,61 | 13,91 |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | 0,47 | -4,14 | 1,19 | 9,81 | 15,95 | 2,23 | 6,52 | 13,73 |
| IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK | 0,42 | 1,23 | 2,70 | 4,46 | 10,12 | 22,51 | | |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,44 | 1,17 | 2,59 | 4,43 | 9,98 | 22,02 | 0,48 | 1,01 |
| IMA GERAL - BENCHMARK | 0,64 | 1,11 | 2,75 | 5,15 | 14,09 | 26,08 | | |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I | 0,58 | 1,24 | 2,71 | 4,33 | 10,23 | 22,77 | 0,41 | 0,86 |
| IMA-B - BENCHMARK | 0,55 | 0,10 | 2,85 | 3,87 | 14,70 | 23,81 | | |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 0,52 | 0,04 | 2,77 | 3,70 | 14,35 | 23,01 | 0,79 | 1,67 |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 0,26 | -0,30 | 2,53 | 2,90 | 14,00 | 21,41 | 1,05 | 2,21 |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | -2,07 | -0,98 | -0,07 | 2,26 | 4,39 | 9,28 | 4,79 | 10,08 |
| IMA-B 5 - BENCHMARK | 0,59 | 1,28 | 2,76 | 4,42 | 10,44 | 23,21 | | |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 0,58 | 1,24 | 2,70 | 4,31 | 10,24 | 22,71 | 0,41 | 0,86 |

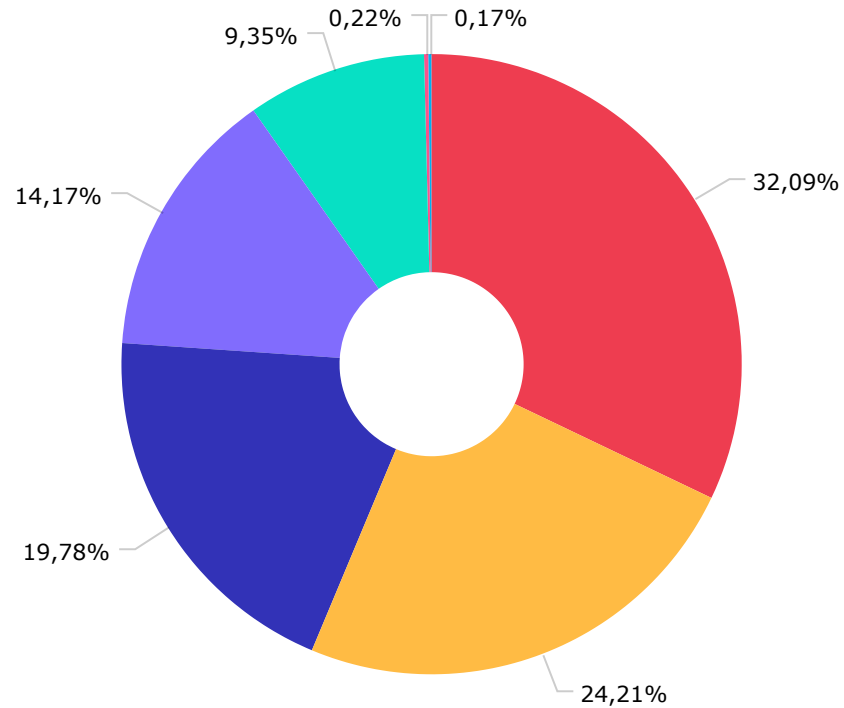
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|-------------|--------------|-------------|-------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| IMA-B 5+ - BENCHMARK | 0,51 | -0,96 | 2,94 | 3,37 | 18,26 | 24,00 | | |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,50 | -0,97 | 2,93 | 3,41 | 17,93 | 23,32 | 1,25 | 2,63 |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA | 0,48 | -1,02 | 2,85 | 3,19 | 17,87 | 23,13 | 1,26 | 2,65 |
| IRF-M - BENCHMARK | 0,46 | 1,13 | 2,63 | 5,74 | 15,85 | 27,58 | | |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,44 | 1,10 | 2,57 | 5,62 | 15,44 | 26,85 | 0,75 | 1,57 |
| SELIC - BENCHMARK | 0,80 | 1,78 | 2,69 | 5,68 | 12,74 | 27,39 | | |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,90 | 1,99 | 2,95 | 6,17 | 13,60 | 28,88 | 0,05 | 0,11 |







| | |
|------------------------------------|---------------|
| BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN... | 18.044.192,03 |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 13.611.783,44 |
| ITAU UNIBANCO S.A. | 11.121.884,75 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 5.259.013,98 |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA. | 3.970.601,78 |
| SOMMA INVESTIMENTOS S.A. | 2.774.476,66 |
| FINACAP INVESTIMENTOS LTDA | 614.184,98 |
| PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE... | 605.772,74 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 122.784,40 |
| PETRA CAPITAL GESTÃO DE INVEST... | 96.584,86 |



| | |
|--|---------------|
| ■ BANCO BRADESCO S.A. | 18.044.192,03 |
| ■ CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 13.611.783,44 |
| ■ ITAU UNIBANCO S.A. | 11.121.884,75 |
| ■ BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E... | 7.965.036,16 |
| ■ BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 5.259.013,98 |
| ■ DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 122.784,40 |
| ■ FINAXIS CORRETORA DE TÍTULOS E... | 96.584,86 |

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|--------------|--------------|---------------|-------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro | 55.642.361,52 | 1.508.081,97 | 1.423.636,30 | 55.559.669,86 | -167.137,33 | -167.137,33 | -0,30% ▼ | -0,30% | 0,87% | 0,87% | -34,48% | 1,79% |
| Fevereiro | 55.559.669,86 | 387.000,00 | 274.816,67 | 56.098.495,22 | 426.642,03 | 259.504,70 | 0,77% ▲ | 0,46% | 1,06% | 1,94% | 23,71% | 1,74% |

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

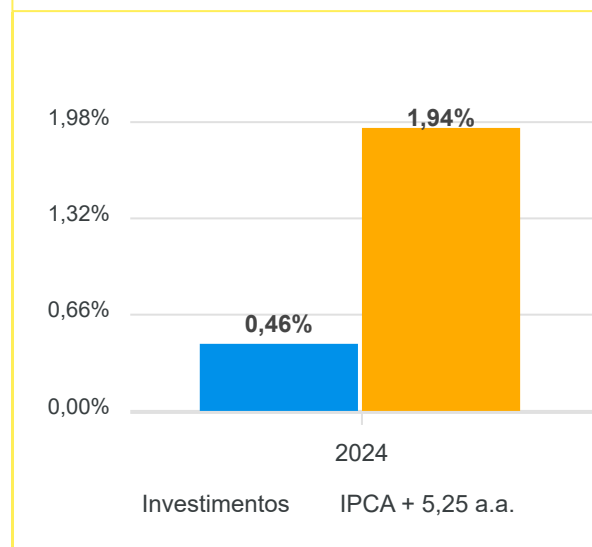


Gráfico Risco x Retorno

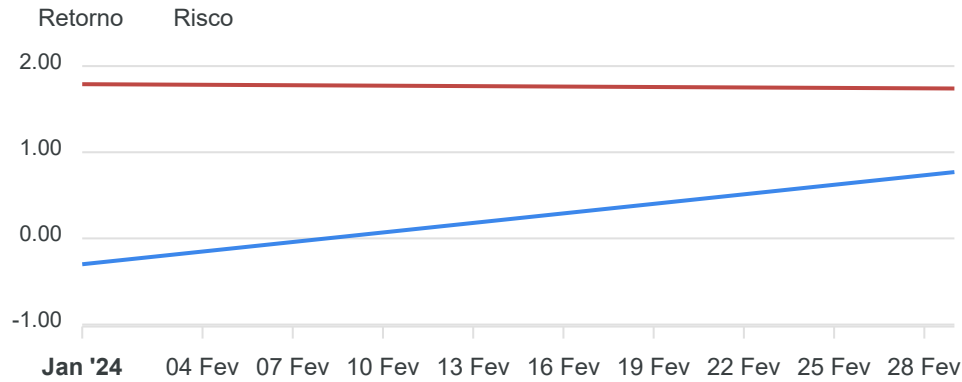
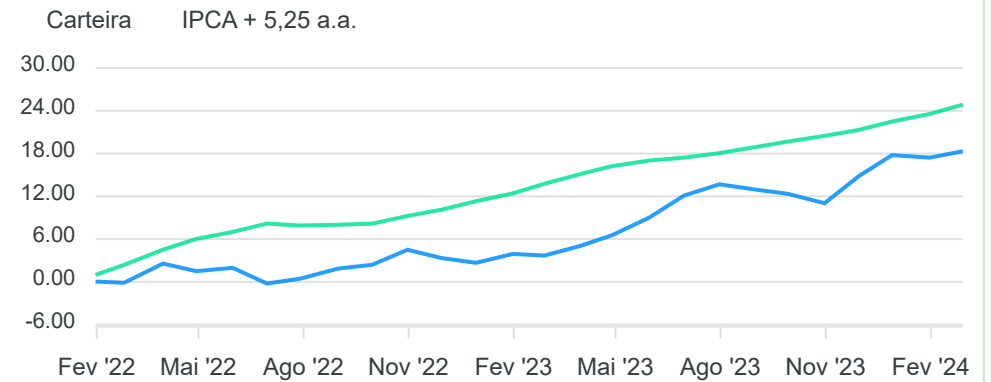
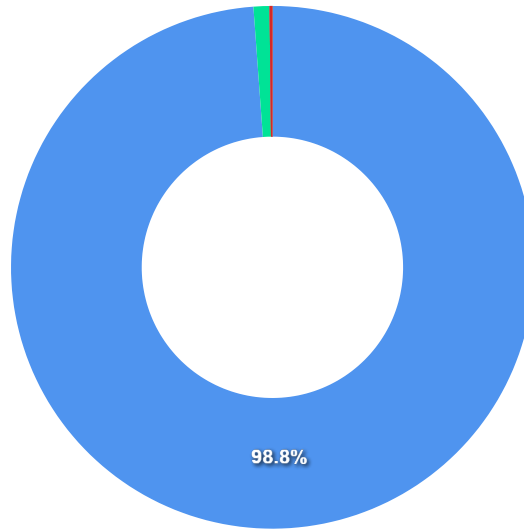


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 29/02/2024

| Disponibilidade | Valor | % |
|-----------------|---------------|-------|
| Até D+30 | 55.569.892,17 | 99,06 |
| Até D+180 | 554.802,59 | 0,99 |
| 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 | 96.584,86 | 0,17 |



| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|------------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 3.690.185,98 | 0,00 | 0,00 | 3.711.428,69 | 21.242,71 | 0,58% ▲ | 0,41% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.540.838,32 | 0,00 | 0,00 | 1.547.585,29 | 6.746,97 | 0,44% ▲ | 0,75% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA | 151.045,97 | 0,00 | 0,00 | 151.772,32 | 726,35 | 0,48% ▲ | 1,26% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 13.610.870,33 | 0,00 | 0,00 | 13.682.209,40 | 71.339,07 | 0,52% ▲ | 0,79% |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 4.172.820,26 | 0,00 | 0,00 | 4.210.210,31 | 37.390,05 | 0,90% ▲ | 0,05% |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 566.509,88 | 0,00 | 15.816,67 | 554.802,59 | 4.109,38 | 0,73% ▲ | 4,79% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 8.479.573,58 | 0,00 | 0,00 | 8.516.801,27 | 37.227,69 | 0,44% ▲ | 0,48% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3.153.562,17 | 0,00 | 0,00 | 3.169.245,98 | 15.683,81 | 0,50% ▲ | 1,25% |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 6.011.186,37 | 0,00 | 0,00 | 6.027.072,80 | 15.886,43 | 0,26% ▲ | 1,05% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I | 4.588.267,67 | 290.000,00 | 130.000,00 | 4.775.496,25 | 27.228,58 | 0,56% ▲ | 0,41% |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES | 348.255,14 | 97.000,00 | 129.000,00 | 319.315,70 | 3.060,56 | 0,69% ▲ | 0,00% |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1 | 96.762,75 | 0,00 | 0,00 | 96.584,86 | -177,89 | -0,18% ▼ | 0,63% |
| | 46.409.878,42 | 387.000,00 | 274.816,67 | 46.762.525,46 | 240.463,71 | 0,52% | 0,70% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|------------------------------|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES | 3.898.246,55 | 0,00 | 0,00 | 3.970.601,78 | 72.355,23 | 1,86% ▲ | 6,61% |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 600.000,00 | 0,00 | 0,00 | 614.184,98 | 14.184,98 | 2,36% ▲ | 7,70% |
| PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES | 600.000,00 | 0,00 | 0,00 | 605.772,74 | 5.772,74 | 0,96% ▲ | 6,13% |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | 2.761.493,61 | 0,00 | 0,00 | 2.774.476,66 | 12.983,05 | 0,47% ▲ | 6,52% |
| - | 7.859.740,16 | 0,00 | 0,00 | 7.965.036,16 | 105.296,00 | 1,34% | 6,63% |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 1.290.051,28 | 0,00 | 0,00 | 1.370.933,60 | 80.882,32 | 6,27% ▲ | 8,72% |
| | 1.290.051,28 | 0,00 | 0,00 | 1.370.933,60 | 80.882,32 | 6,27% | 0,00% |

Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **PREVDUASBARRAS INST PREV SERV PUB MUNC DUAS BARRAS - RJ** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Fevereiro/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 **PREVDUASBARRAS INST PREV SERV PUB MUNC DUAS BARRAS - RJ** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Fevereiro/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 **PREVDUASBARRAS INST PREV SERV PUB MUNC DUAS BARRAS - RJ** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

