

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
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.739.320,03	6,57%	5.297.621.800,71	0,07%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.555.376,70	2,73%	4.229.973.113,40	0,04%	7º I b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	13.689.401,07	24,06%	616.455.068,63	2,22%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	559.881,43	0,98%	498.760.290,91	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.593.286,08	15,10%	5.081.326.495,59	0,17%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.151.525,65	5,54%	1.366.454.531,96	0,23%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	4.811.508,40	8,46%	1.549.129.506,23	0,31%	7º I b
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	277.859,45	0,49%	40.444.383.750,43	0,00%	7º I b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	150.885,93	0,27%	142.065.504,83	0,11%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.880.573,78	8,58%	10.645.688.775,75	0,05%	7º III a
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	6.027.283,07	10,59%	428.881.205,20	1,41%	7º III a
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	96.106,66	0,17%	29.091.268,29	0,33%	7º V a
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3.961.730,91	6,96%	214.379.683,33	1,85%	8º I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	623.768,26	1,10%	446.896.811,40	0,14%	8º I
MAG BRASIL FI AÇÕES	2.768.903,69	4,87%	311.082.786,21	0,89%	8º I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	592.288,00	1,04%	293.755.946,84	0,20%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.418.613,10	2,49%	2.280.222.056,45	0,06%	9º III

Investimentos


\$ 56.898.312,21

Disponibilidades Financeiras

\$ 277.680,95

Total Carteira

\$ 57.175.993,16

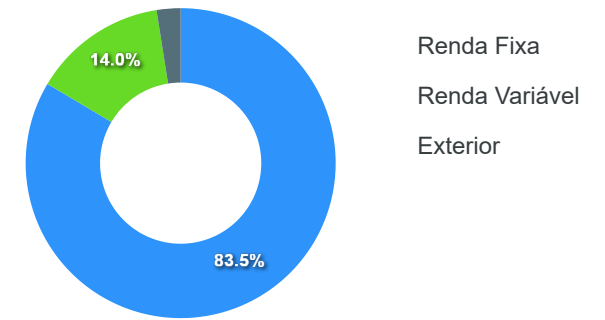
Governança (Pró Gestão)
 NIVEL 1 29/05/2026

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Utilizado	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	63,94%	36.378.158,81	36,06%	20.520.153,40
7º III a - FI Referenciados RF	65,00%	19,44%	11.058.742,78	45,56%	25.925.160,16
7º V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	0,17%	96.106,66	4,83%	2.748.808,95
8º I - Fundos de Ações	35,00%	13,97%	7.946.690,86	21,03%	11.967.718,41
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	2,49%	1.418.613,10	7,51%	4.271.218,12

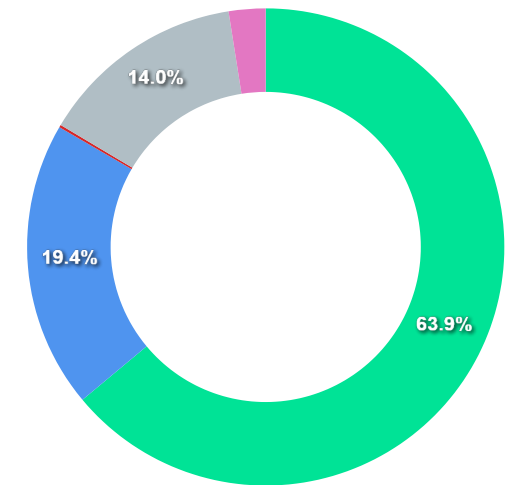
Governança (Pró Gestão)

🔗 NIVEL 1 29/05/2026

Segmentos



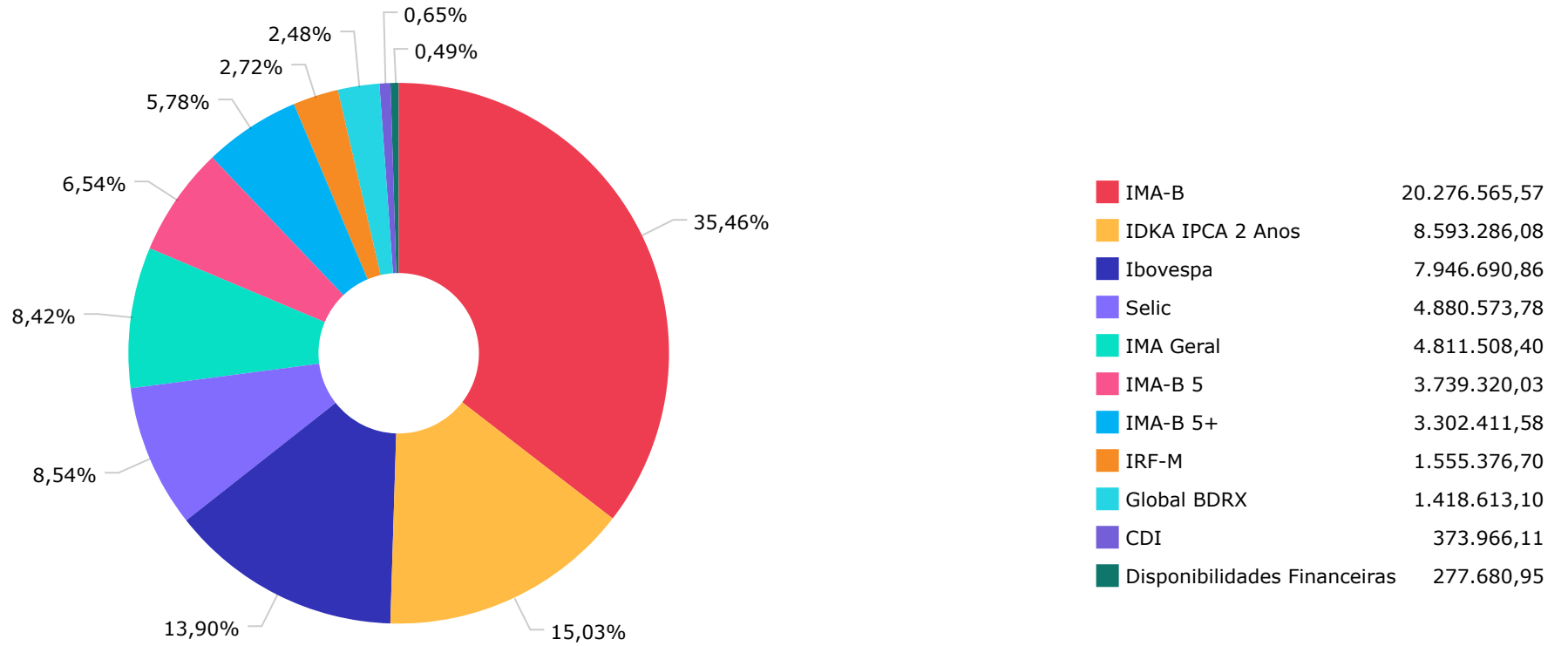
Artigos

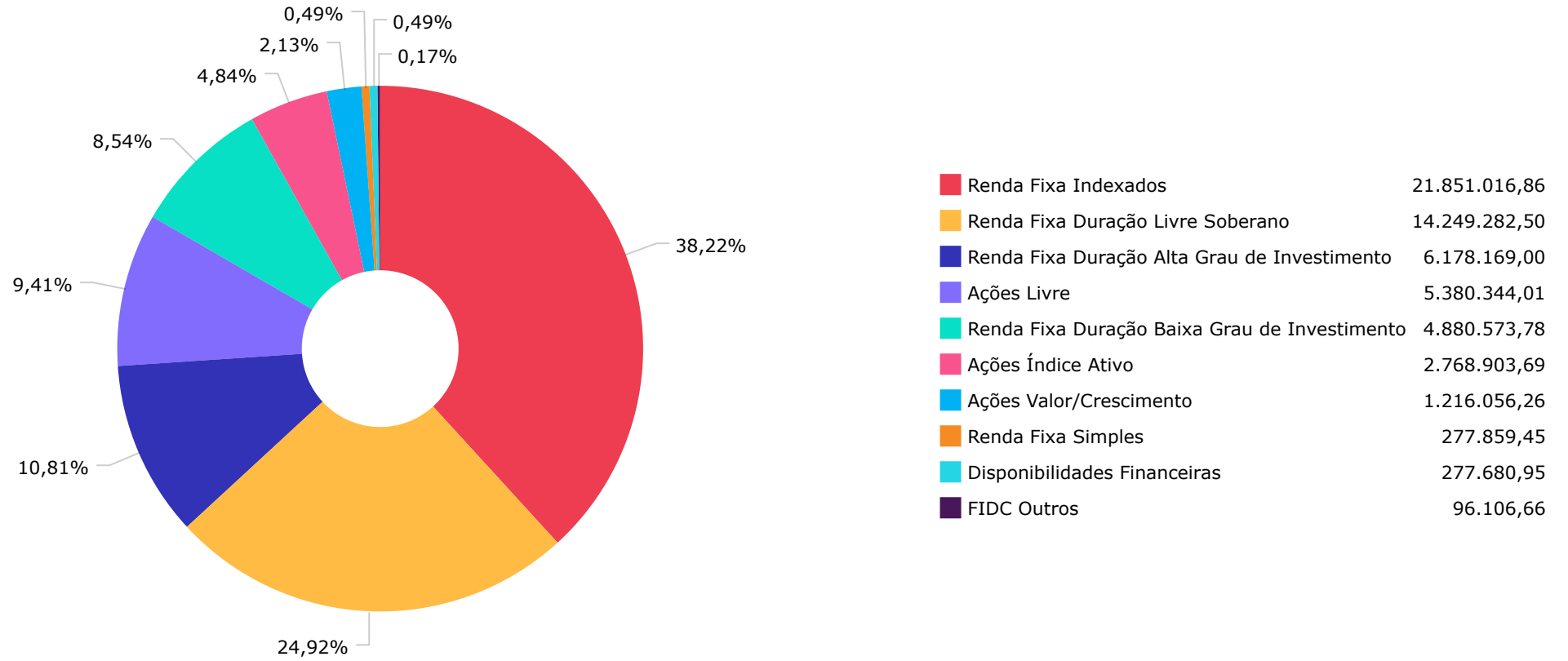


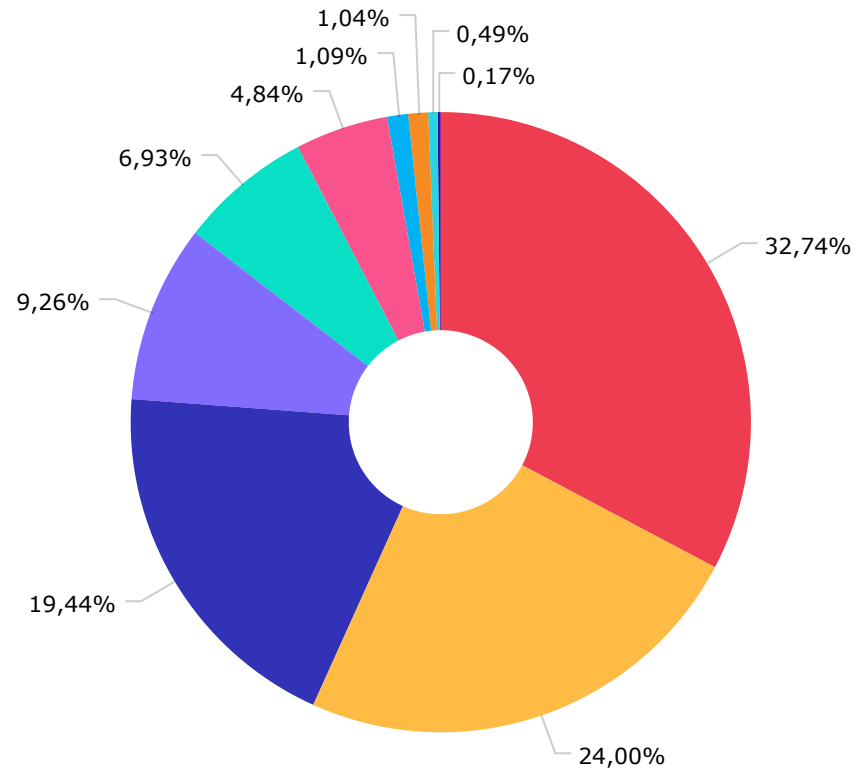
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	56.898.312,21	8° I - Fundos de Ações	13,97%	0,00%	15,00%	35,00%	11.967.718,41
7° I b - FI 100% Títulos TN	63,94%	0,00%	54,00%	100,00%	20.520.153,40	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	35,00%	19.914.409,27
7° III a - FI Referenciados RF	19,44%	0,00%	20,00%	65,00%	25.925.160,16	9° III - Ações - BDR Nível I	2,49%	0,00%	2,00%	10,00%	4.271.218,12
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	11.379.662,44	10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	5.689.831,22
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,17%	0,00%	1,00%	5,00%	2.748.808,95	11° - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.844.915,61
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.844.915,61						
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.844.915,61						

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28		
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,83	2,61	2,61	5,47	12,28	27,05	0,01	0,02
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,50	-1,42	-1,42	-7,00	-15,14	-62,09	0,73	1,53
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	4,04	15,88	15,88	24,88	34,65	30,56		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,48	14,98	14,98	23,77	32,44	27,69	5,89	12,41
IBOVESPA - BENCHMARK	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76		
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1,56	-1,23	-1,23	13,54	32,70	16,26	4,43	9,34
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-0,22	-0,11	-0,11	10,71	26,12	4,00	5,65	11,90
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,23	-4,19	-4,19	8,65	22,87	21,74	4,58	9,64
MAG BRASIL FI AÇÕES	-0,20	-4,33	-4,33	8,79	21,69	-2,17	5,09	10,72
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90	2,08	2,08	5,00	9,45	19,97	0,52	1,10
IMA GERAL - BENCHMARK	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78		
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,75	2,01	2,01	4,99	9,42	20,58	0,44	0,93
IMA-B - BENCHMARK	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21		
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,05	0,10	0,10	4,78	11,47	19,46	1,08	2,28
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	-0,29	-0,29	4,22	10,91	17,32	1,26	2,65
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92	-0,08	-0,08	2,08	4,02	7,43	0,20	0,42
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01		
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,75	2,00	2,00	4,98	9,44	20,53	0,44	0,93

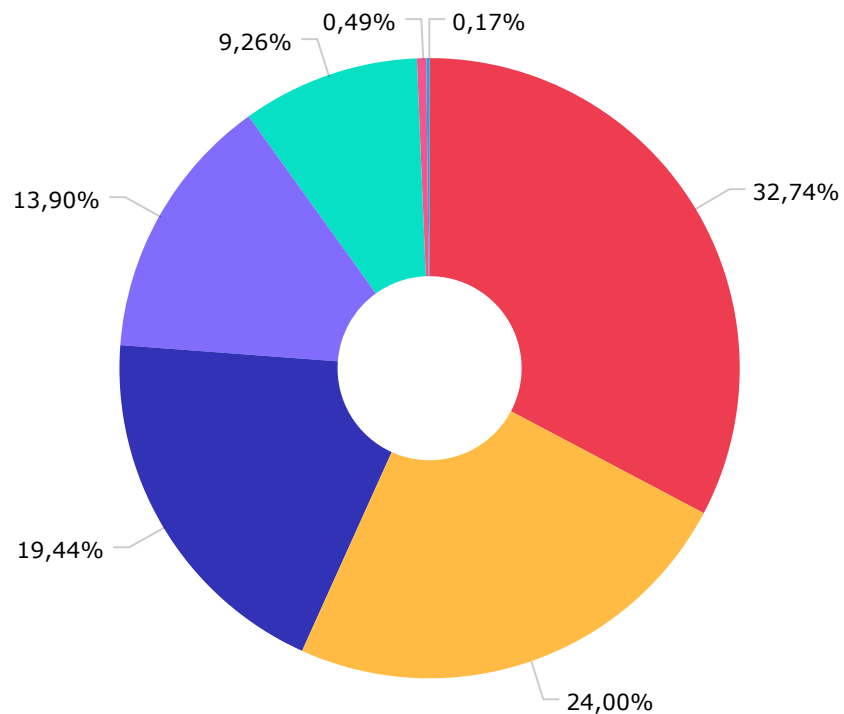
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,56	-1,52	-1,52	4,78	13,13	18,45	1,68	3,53
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,58	-1,60	-1,60	4,63	13,00	18,32	1,70	3,58
IRF-M - BENCHMARK	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20		
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50	1,61	1,61	6,00	13,61	26,42	0,72	1,51
SELIC - BENCHMARK	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91	2,92	2,92	6,02	13,31	28,84	0,03	0,06







BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	18.720.860,78
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.723.306,26
ITAU UNIBANCO S.A.	11.116.650,92
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	5.294.696,73
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	3.961.730,91
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	2.768.903,69
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	623.768,26
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	592.288,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	277.680,95
PETRA CAPITAL GESTÃO DE INVEST...	96.106,66



■ BANCO BRADESCO S.A.	18.720.860,78
■ CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.723.306,26
■ ITAU UNIBANCO S.A.	11.116.650,92
■ BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	7.946.690,86
■ BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	5.294.696,73
■ DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	277.680,95
■ FINAXIS CORRETORA DE TÍTULOS E...	96.106,66

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	908.081,97	1.423.636,30	54.959.669,86	-167.137,33	-167.137,33	-0,30% ▼	-0,30%	0,87%	0,87%	-34,48%	1,73%
Fevereiro	54.959.669,86	987.000,00	274.816,67	56.098.495,22	426.642,03	259.504,70	0,77% ▲	0,46%	1,22%	2,10%	21,90%	1,74%
Março	56.098.495,22	648.329,21	64.000,00	56.898.312,21	215.487,78	474.992,48	0,38% ▲	0,85%	0,57%	2,68%	31,72%	1,55%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	474.992,48	0,85%	2,68%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

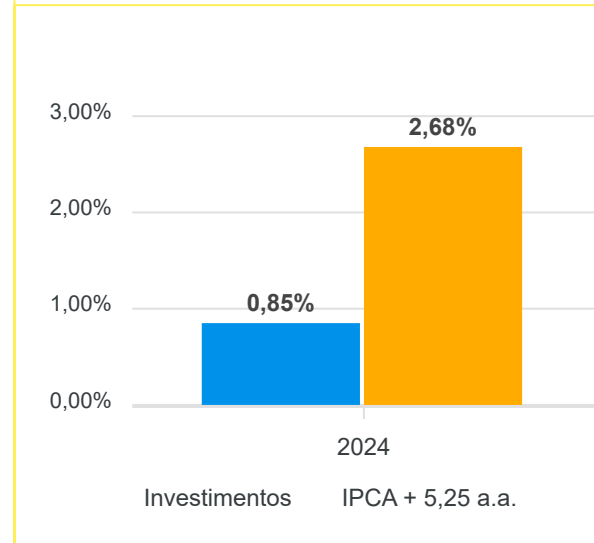


Gráfico Risco x Retorno

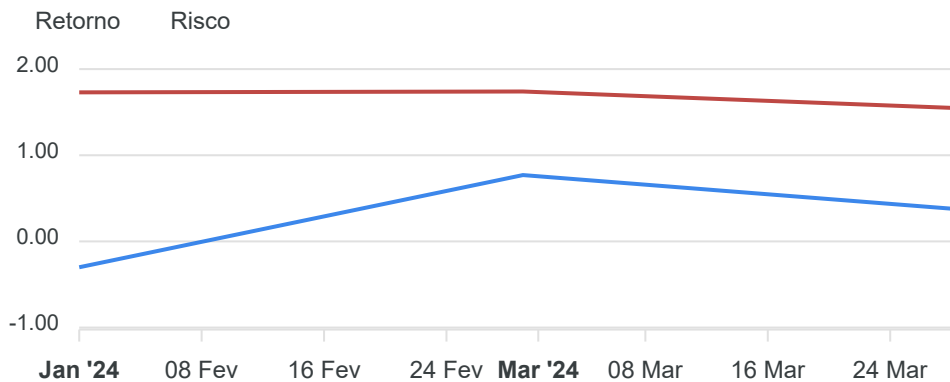
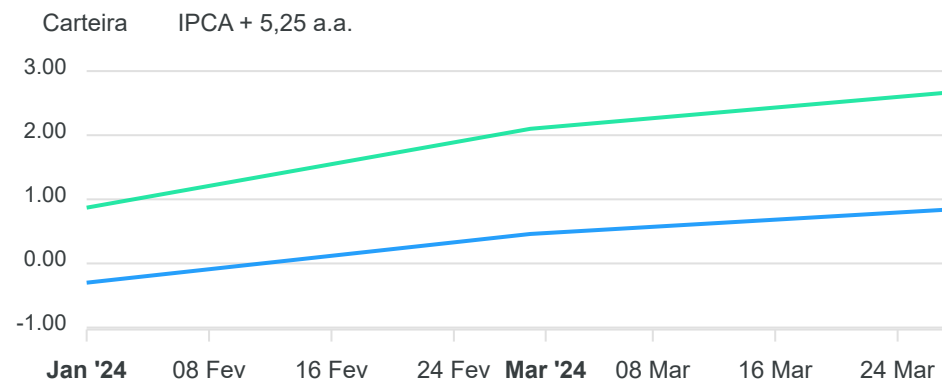
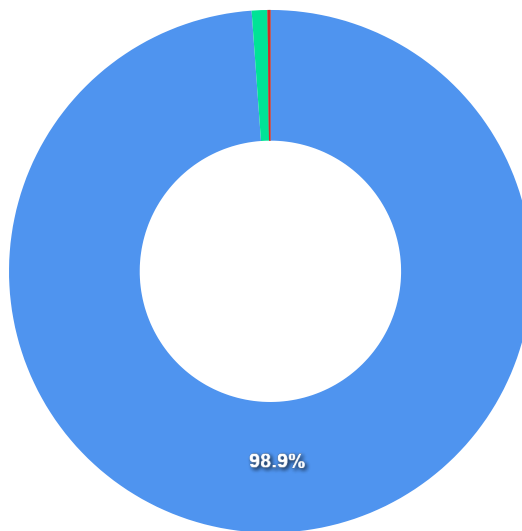


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 28/03/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	56.520.005,07	99,34
Até D+180	559.881,43	0,98
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	96.106,66	0,17



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.711.428,69	0,00	0,00	3.739.320,03	27.891,34	0,75% ▲	0,44%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.547.585,29	0,00	0,00	1.555.376,70	7.791,41	0,50% ▲	0,72%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	151.772,32	0,00	0,00	150.885,93	-886,39	-0,58% ▼	1,70%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	13.682.209,40	0,00	0,00	13.689.401,07	7.191,67	0,05% ▲	1,08%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.210.210,31	628.329,21	0,00	4.880.573,78	42.034,26	0,87% ▲	0,03%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	554.802,59	0,00	0,00	559.881,43	5.078,84	0,92% ▲	0,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.516.801,27	0,00	0,00	8.593.286,08	76.484,81	0,90% ▲	0,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.169.245,98	0,00	0,00	3.151.525,65	-17.720,33	-0,56% ▼	1,68%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	6.027.072,80	0,00	0,00	6.027.283,07	210,27	0,00% ▲	1,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	4.775.496,25	0,00	0,00	4.811.508,40	36.012,15	0,75% ▲	0,44%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	319.315,70	20.000,00	64.000,00	277.859,45	2.543,75	0,75% ▲	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	96.584,86	0,00	0,00	96.106,66	-478,20	-0,50% ▼	0,73%
	46.762.525,46	648.329,21	64.000,00	47.533.008,25	186.153,58	0,39%	0,79%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3.970.601,78	0,00	0,00	3.961.730,91	-8.870,87	-0,22% ▼	5,65%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	614.184,98	0,00	0,00	623.768,26	9.583,28	1,56% ▲	4,43%
MAG BRASIL FI AÇÕES	2.774.476,66	0,00	0,00	2.768.903,69	-5.572,97	-0,20% ▼	5,09%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	605.772,74	0,00	0,00	592.288,00	-13.484,74	-2,23% ▼	4,58%
-	7.965.036,16	0,00	0,00	7.946.690,86	-18.345,30	-0,23%	5,28%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.370.933,60	0,00	0,00	1.418.613,10	47.679,50	3,48% ▲	5,89%
	1.370.933,60	0,00	0,00	1.418.613,10	47.679,50	3,48%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.665.982,58	0,00	0,00	3.739.320,03	73.337,45	2,00% ▲
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.530.762,88	0,00	0,00	1.555.376,70	24.613,82	1,61% ▲
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	153.339,82	0,00	0,00	150.885,93	-2.453,89	-1,60% ▼
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	13.676.171,28	0,00	0,00	13.689.401,07	13.229,79	0,10% ▲
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.869.309,81	887.329,21	0,00	4.880.573,78	123.934,76	2,61% ▲
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	560.314,05	0,00	15.816,67	559.881,43	15.384,05	2,75% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.418.166,32	0,00	0,00	8.593.286,08	175.119,76	2,08% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.200.199,15	0,00	0,00	3.151.525,65	-48.673,50	-1,52% ▼
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	6.044.923,25	0,00	0,00	6.027.283,07	-17.640,18	-0,29% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	4.558.102,61	290.000,00	130.000,00	4.811.508,40	93.405,79	1,93% ▲
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	357.360,01	166.081,97	255.000,00	277.859,45	9.417,47	1,80% ▲
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	97.491,23	0,00	0,00	96.106,66	-1.384,57	-1,42% ▼
	46.132.122,99	1.343.411,18	400.816,67	47.533.008,25	458.290,75	0,97%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	1.416.228,46	0,00	1.361.636,30	0,00	-54.592,16	-3,85% ▼
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3.966.043,74	0,00	0,00	3.961.730,91	-4.312,83	-0,11% ▼
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,00	600.000,00	0,00	623.768,26	23.768,26	3,96% ▲
MAG BRASIL FI AÇÕES	2.894.185,80	0,00	0,00	2.768.903,69	-125.282,11	-4,33% ▼
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	600.000,00	0,00	592.288,00	-7.712,00	-1,29% ▼
	8.276.458,00	1.200.000,00	1.361.636,30	7.946.690,86	-168.130,84	-2,03%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	1.233.780,53	0,00	0,00	1.418.613,10	184.832,57	14,98% ▲
	1.233.780,53	0,00	0,00	1.418.613,10	184.832,57	14,98%

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 **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 **PREVDUASBARRAS INST PREV SERV PUB MUNC DUAS BARRAS - RJ** 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 **PREVDUASBARRAS INST PREV SERV PUB MUNC DUAS BARRAS - RJ** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

