

2024

Relatório Mensal, 2º trimestre e 1º semestre de 2024

Junho

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 TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.076.530,09	9,70%	3.477.615.018,87	0,29%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.597.924,90	9,24%	513.008.318,61	1,87%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.808.066,26	3,67%	57.866.352,30	6,58%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	46.022.418,19	44,32%	4.038.072.337,63	1,14%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	34.345.460,20	33,07%	198.418.875,04	17,31%	7º I b

Investimentos

\$ 103.850.399,64


Disponibilidades Financeiras

\$ 10.003.276,31

Total Carteira

\$ 113.853.675,95

Governança (Pró Gestão)

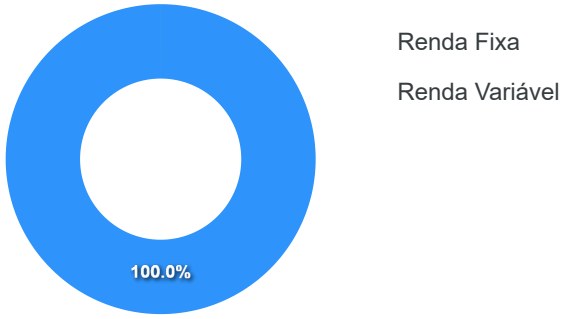
 NIVEL 3 23/11/2024

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	100,00%	103.850.399,64 0,00% 0,00

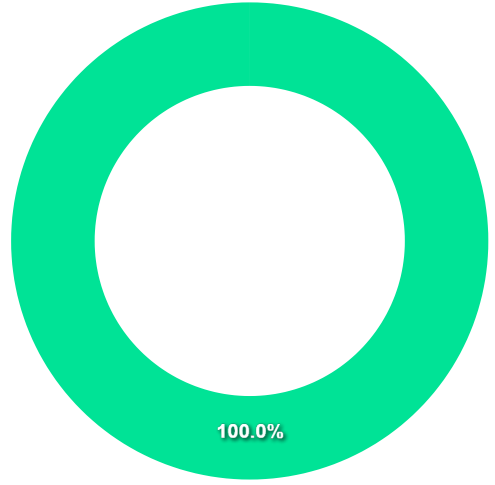
Governança (Pró Gestão)

🔗 NIVEL 3 23/11/2024

Segmentos

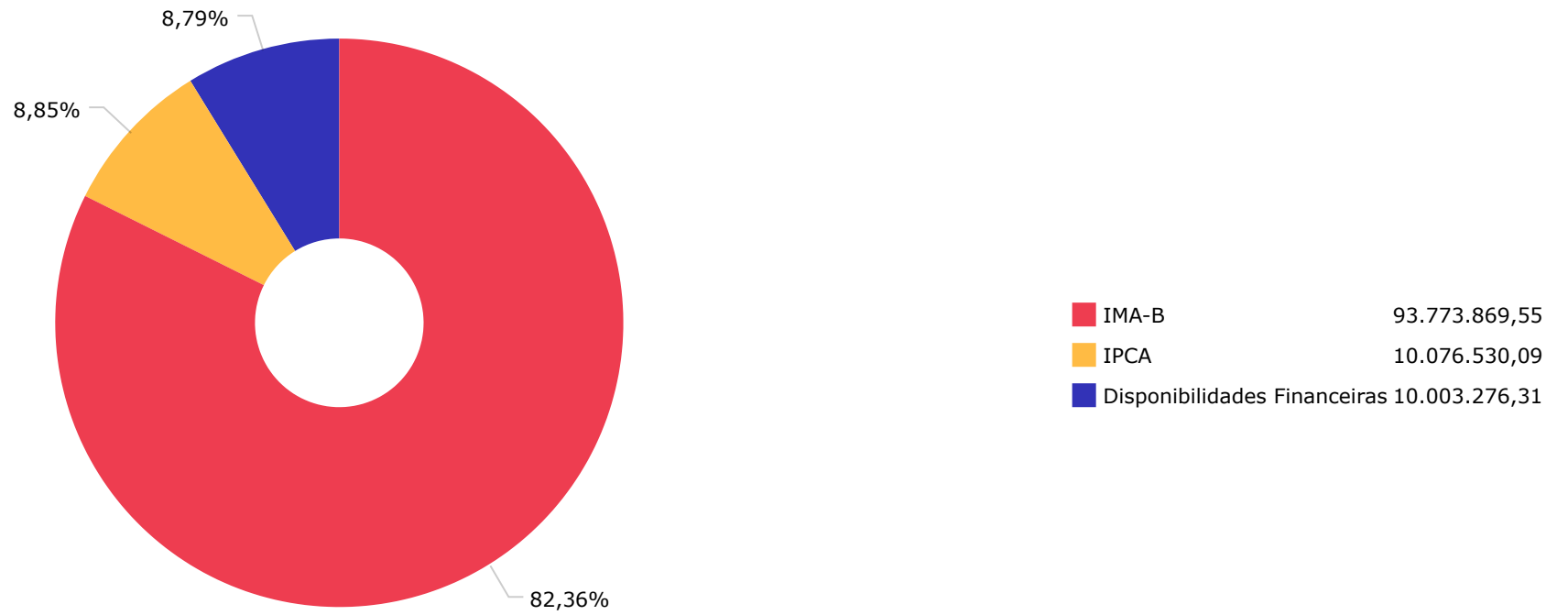


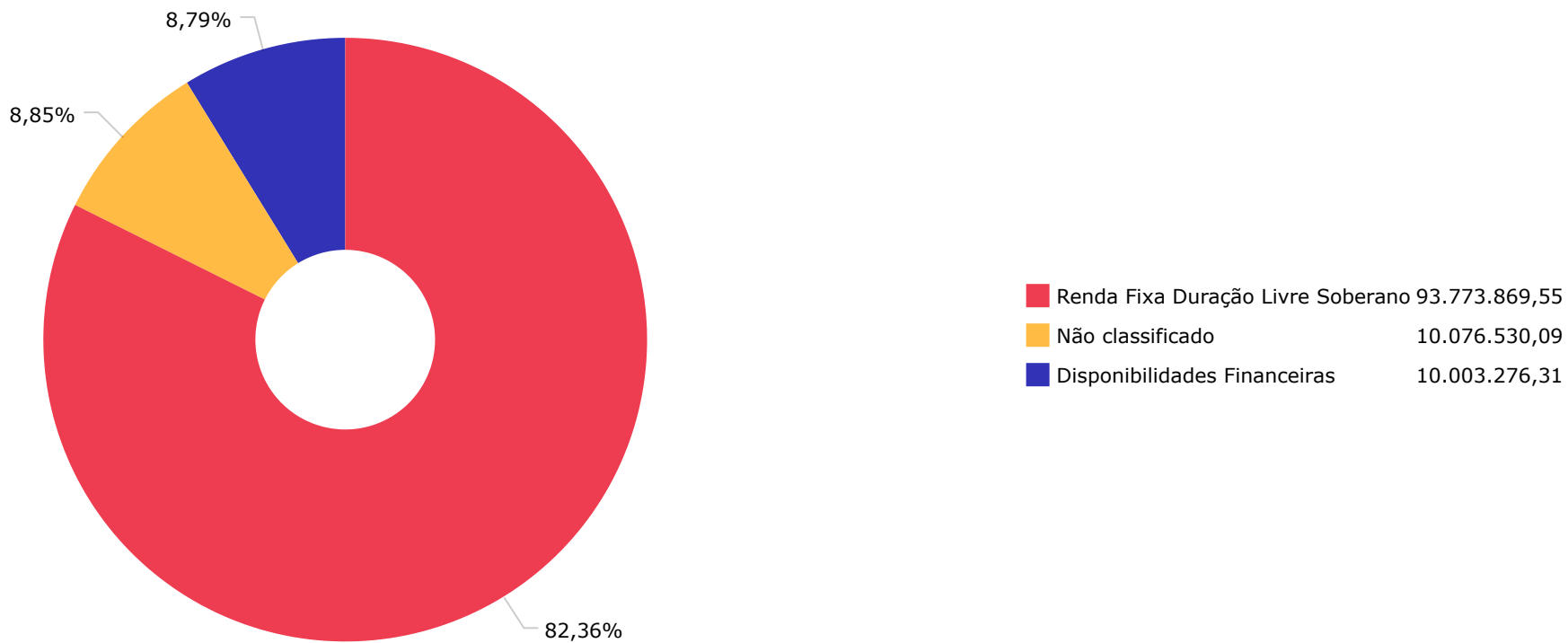
Artigos

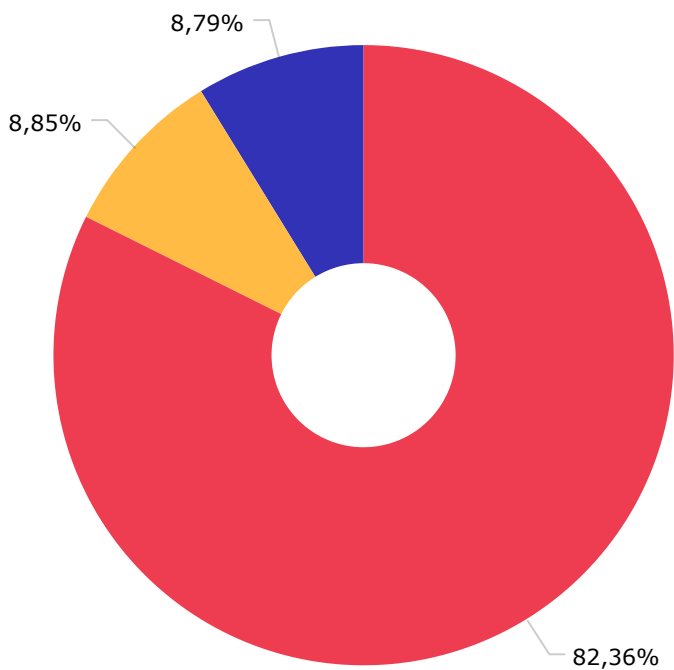


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	103.850.399,64						
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	0,00%	79,00%	100,00%	0,00						
7° III a - FI Referenciados RF	0,00%	0,00%	20,00%	75,00%	77.887.799,73						

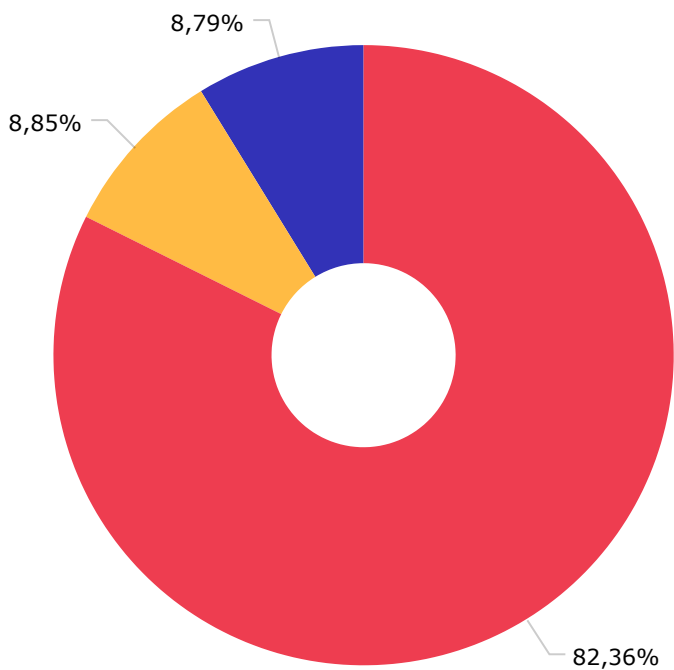
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B - BENCHMARK	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01		
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16	2,78	2,86	2,78	5,47	7,94	0,48	1,02
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16	2,73	2,85	2,73	5,47	7,92	0,48	1,02
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16	2,76	2,85	2,76	5,47	7,93	0,48	1,02
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16	2,79	2,86	2,79	5,45	7,72	0,48	1,02
IPCA - BENCHMARK	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52		
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17	5,78	2,88	5,78	11,45		0,48	1,02







CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	93.773.869,55
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	10.076.530,09
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	10.003.276,31



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	93.773.869,55
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	10.076.530,09
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	10.003.276,31

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	128.282.392,38	28.001.200,73	40.001.200,73	117.741.330,05	1.458.937,67	1.458.937,67	1,14% ▲	1,14%	0,84%	0,84%	135,71%	0,26%
Fevereiro	117.741.330,05	30.560.494,69	32.061.536,97	116.132.869,31	-107.418,46	1.351.519,21	-0,09% ▼	1,05%	1,19%	2,04%	51,47%	3,74%
Março	116.132.869,31	37.844.833,50	56.723.670,36	98.345.119,99	1.091.087,54	2.442.606,75	0,94% ▲	1,99%	0,54%	2,59%	76,83%	0,19%
Abril	98.345.119,99	70.925.091,44	72.750.844,19	97.390.559,91	871.192,67	3.313.799,42	0,89% ▲	2,90%	0,80%	3,40%	85,29%	0,25%
Mai	97.390.559,91	39.788.713,56	44.372.649,35	93.708.465,83	901.841,71	4.215.641,13	0,93% ▲	3,85%	0,86%	4,29%	89,74%	0,64%
Junho	93.708.465,83	36.529.280,78	27.563.896,60	103.850.399,64	1.176.549,63	5.392.190,76	1,15% ▲	5,04%	0,59%	4,91%	102,65%	0,48%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	2.442.606,75	1,99%	2,59%
2º Trim	2.949.584,01	2,99%	2,26%
1º Sem	5.392.190,76	5,04%	4,91%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

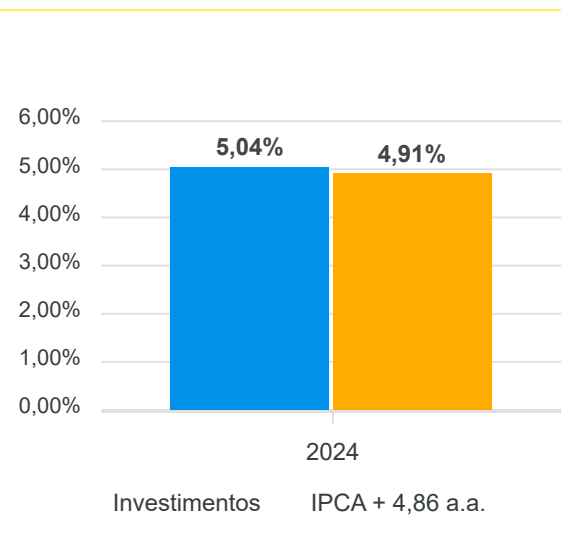


Gráfico Risco x Retorno

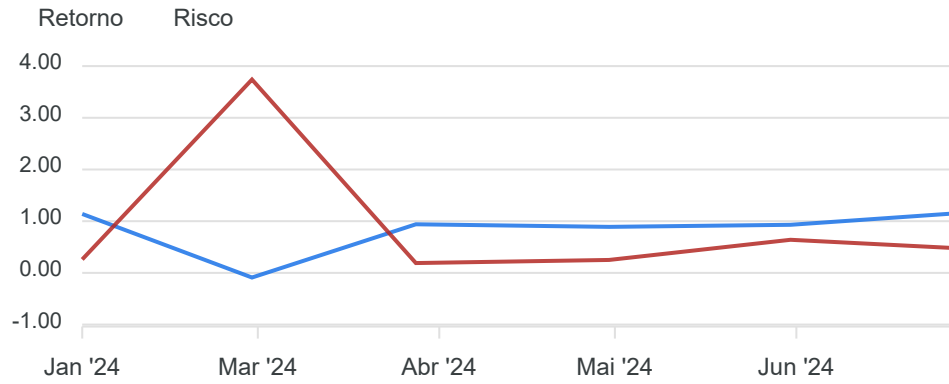
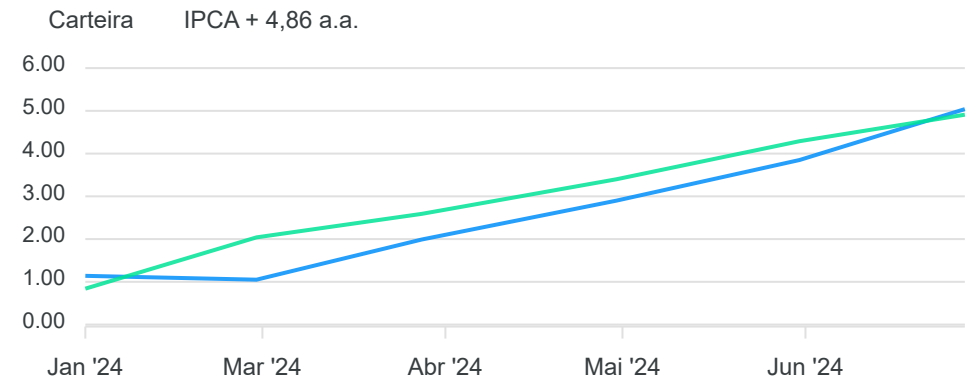
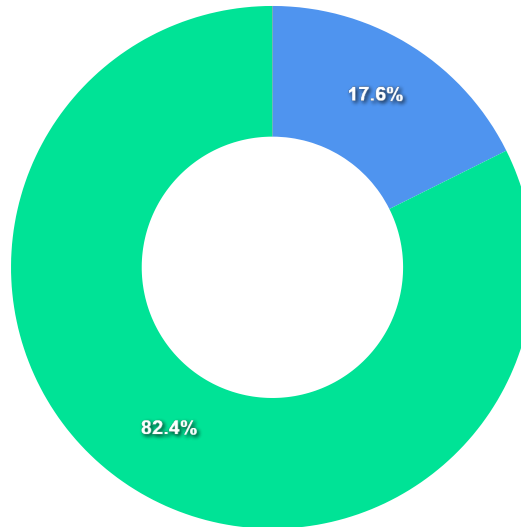


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 28/06/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	20.079.806,40	19,34
Até D+180	93.773.869,55	90,30
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	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.008.225,37	15.040.909,28	16.071.021,68	0,00	21.887,03	0,14% ▲	-
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.488.156,30	0,00	0,00	9.597.924,90	109.768,60	1,16% ▲	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.764.514,10	0,00	0,00	3.808.066,26	43.552,16	1,16% ▲	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	45.494.957,06	0,00	0,00	46.022.418,19	527.461,13	1,16% ▲	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	33.952.613,00	0,00	0,00	34.345.460,20	392.847,20	1,16% ▲	0,48%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	11.488.371,50	11.492.874,92	0,00	4.503,42	0,04% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	10.000.000,00	0,00	10.076.530,09	76.530,09	0,77% ▲	0,48%
	93.708.465,83	36.529.280,78	27.563.896,60	103.850.399,64	1.176.549,63	1,15%	0,48%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	61.389.235,65	61.411.568,56	0,00	22.332,91	0,04% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	7.176.707,80	75.853.850,13	83.275.821,58	0,00	245.263,65	0,30% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	10.000.000,00	0,00	10.076.530,09	76.530,09	0,77% ▲
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.331.357,10	0,00	0,00	9.597.924,90	266.567,80	2,86% ▲
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.702.407,68	0,00	0,00	3.808.066,26	105.658,58	2,85% ▲
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	44.742.241,21	0,00	0,00	46.022.418,19	1.280.176,98	2,86% ▲
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	33.392.406,20	0,00	0,00	34.345.460,20	953.054,00	2,85% ▲
	98.345.119,99	147.243.085,78	144.687.390,14	103.850.399,64	2.949.584,01	2,92%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	62.840.363,29	62.864.301,02	0,00	23.937,73	0,04% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	23.140.631,78	166.809.251,41	190.835.515,78	0,00	885.632,59	0,47% ▲
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	13.897.678,18	4.000.000,00	18.140.588,21	0,00	242.910,03	1,36% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	10.000.000,00	0,00	10.076.530,09	76.530,09	0,77% ▲
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.338.567,50	0,00	263.611,25	9.597.924,90	522.968,65	5,60% ▲
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.706.697,50	0,00	105.950,81	3.808.066,26	207.319,57	5,59% ▲
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	44.774.672,62	0,00	1.263.831,13	46.022.418,19	2.511.576,70	5,61% ▲
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	33.424.144,80	0,00	0,00	34.345.460,20	921.315,40	2,76% ▲
	128.282.392,38	243.649.614,70	273.473.798,20	103.850.399,64	5.392.190,76	4,20%

Cenário Econômico

No fim do ano passado, as expectativas para 2024 eram otimistas. Os analistas esperavam que os juros começassem a cair nos Estados Unidos e seguissem em trajetória de queda no Brasil. Com isso, a bolsa decolava e a renda variável finalmente voltaria a ter mais apelo. Seis meses depois, não foi o que aconteceu. O ciclo de cortes da Selic parou, em 10,5% (pelo menos por enquanto) mais cedo do que o esperado e a bolsa acumula uma queda, no ano, de quase 8%. Até agora, a renda fixa continua sendo a classe mais rentável do país, com o CDI trazendo boa rentabilidade. E, em nossas expectativas, o segundo semestre tende a ir pelo mesmo caminho, a menos que existam mudanças significativas no âmbito fiscal ou na economia norte-americana.

No primeiro semestre, o Ibovespa acumulou uma queda de 7,66%. Dos seis meses até aqui, apenas junho e fevereiro foram de alta na bolsa brasileira. Já o CDI (taxa que acompanha de perto a Selic e é usada como indexador de muitos investimentos de renda fixa) vem entregando uma rentabilidade de 5,22% no ano, mesmo com os cortes de juros feitos em janeiro, março e maio. Até mesmo a boa e velha poupança rendeu mais que a bolsa brasileira, já que ela entregou uma rentabilidade de 3,40% no ano até agora.

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 investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização, estão presentes na lista exaustiva da DRPPS, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

Os resultados no período continuam insatisfatórios. Até agora, a renda fixa e os investimentos no exterior continuam sendo a referência de rentabilidade, com o CDI na renda fixa se destacando na relação risco x retorno. O segmento de renda variável segue comprometido com a bolsa acumulando queda no ano, diante das incertezas no cenário interno combinado com a instabilidade fiscal.

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, 12 de julho de 2024.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+0
Quantidade de Cotistas	382
Patrimônio Líquido Fundo	3.477.615.018,87

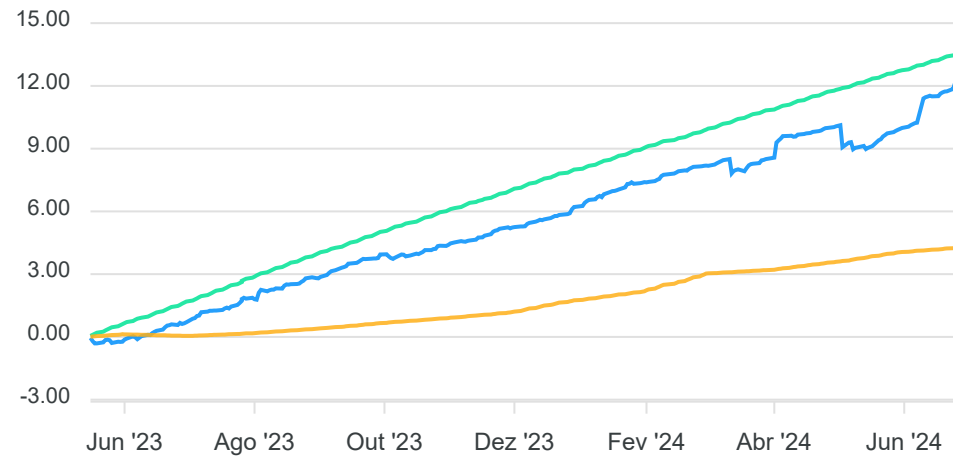
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IPCA
Classificação ANBIMA	Não classificado
Política de Investimento	Aplica seus recursos em títulos públicos federais prefixados indexados e/ou sintetizados para CDI/SELIC, e em operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais e com contraparte classificada como de baixo risco de crédito.

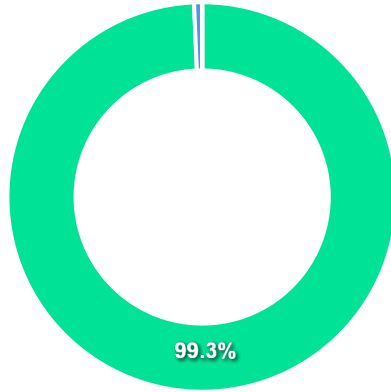
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,17%	5,78%	2,88%	5,78%	11,45%	-%	0,48%	1,02%
Benchmark	0,21%	2,48%	1,05%	2,48%	4,23%	7,52%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	3.150.607,58	99,33	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/03/2030	21.010,47	0,66	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	169,52	0,01	Valores a pagar/receber
Valores a receber / DIFERIR CVM 31/12/24	37,95	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa de Administração	12,50	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	7,71	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	2,03	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-24,94	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.150.607,58	99.33%
Operação compromissada	21.010,47	0.66%
Valores a pagar/receber	166,83	0.01%
Outros	37,95	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 105
Patrimônio Líquido Fundo 513.008.318,61

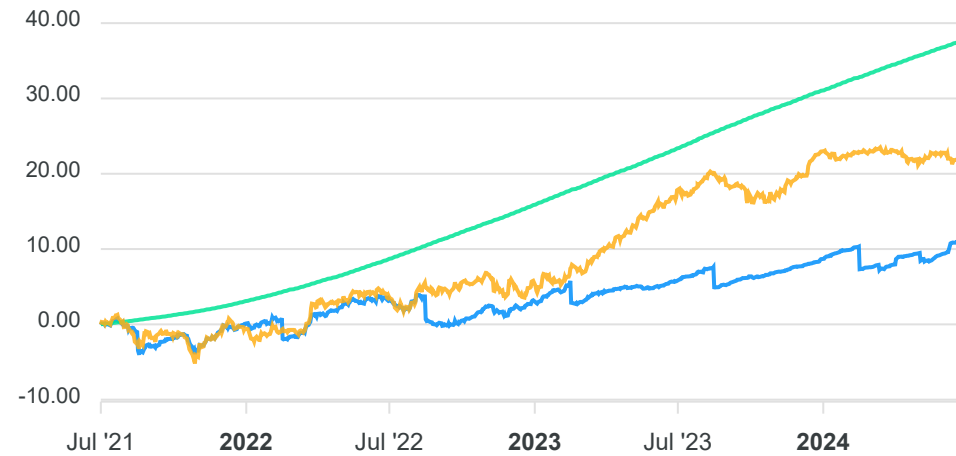
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B
Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós fixadas e/ou índices de preços.

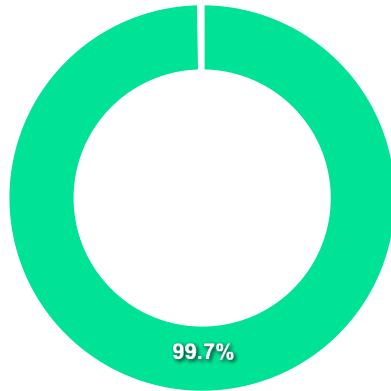
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	2,78%	2,86%	2,78%	5,47%	7,94%	0,48%	1,02%
Benchmark	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	505.793,91	99,73	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	1.338,56	0,26	Operação compromissada
Outros Valores a receber	23,84	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	11,06	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-26,17	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	505.793,91	99.73%
Operação compromissada	1.338,56	0.26%
Valores a pagar/receber	8,73	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
21

Patrimônio Líquido Fundo
57.866.352,30

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

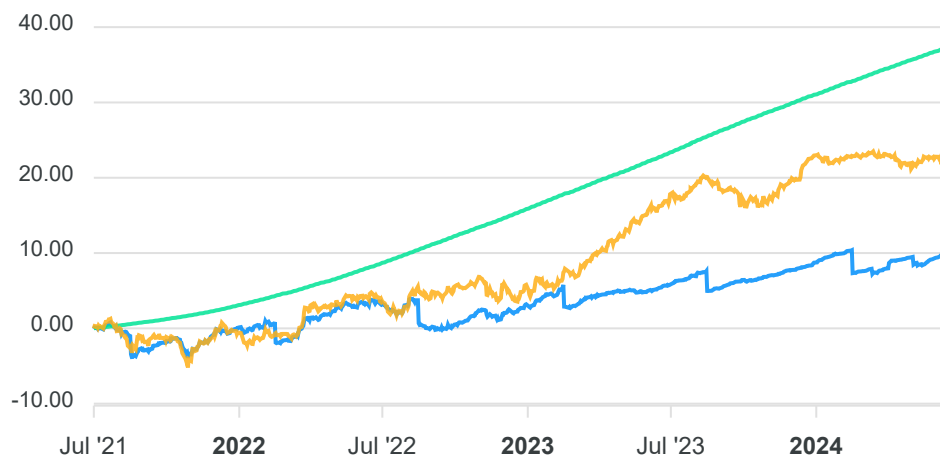
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós- fixadas e/ou índices de preços. Não realiza operações de day-trade.

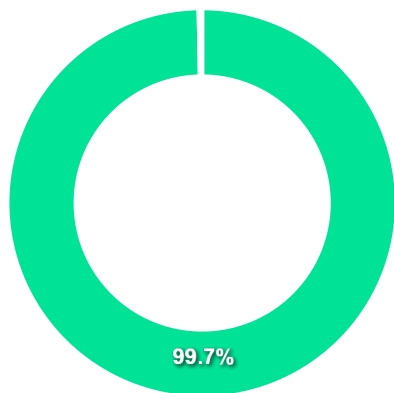
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	2,73%	2,85%	2,73%	5,47%	7,92%	0,48%	1,02%
Benchmark	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	57.035,22	99,70	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	154,17	0,27	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	11,81	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	7,45	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-4,11	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	57.035,22	99.70%
Operação compromissada	154,17	0.27%
Valores a pagar/receber	15,15	0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 308
Patrimônio Líquido Fundo 4.038.072.337,63

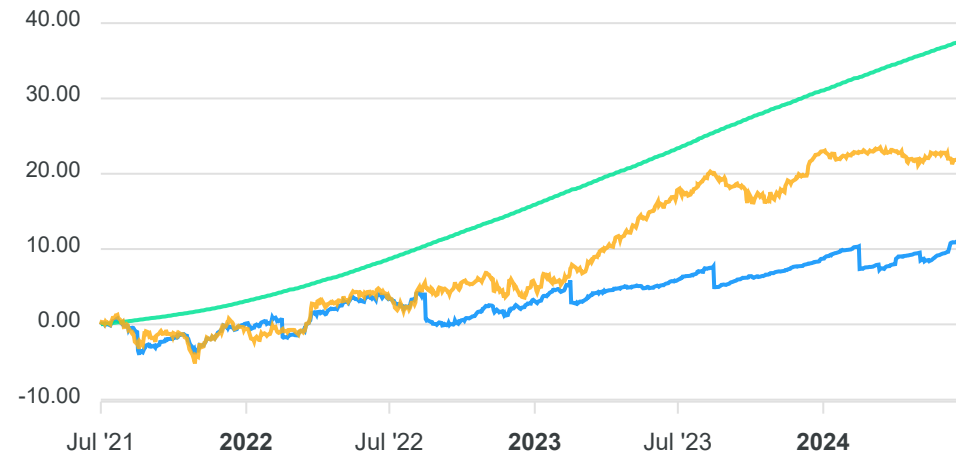
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B
Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento Aplica seus recursos em um único ativo, uma NTN-B com vencimento em 2024.

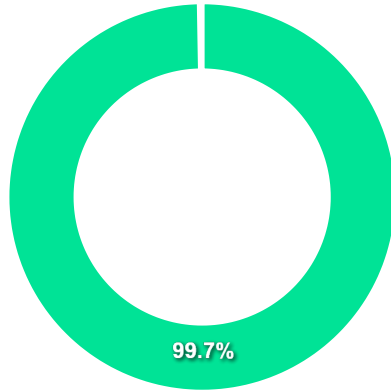
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	2,79%	2,86%	2,79%	5,45%	7,72%	0,48%	1,02%
Benchmark	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	3.970.912,83	99,73	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2026	10.969,25	0,28	Operação compromissada
Outros Valores a receber	33,52	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,93	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-179,49	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.970.912,83	99.73%
Operação compromissada	10.969,25	0.28%
Valores a pagar/receber	-135,03	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Gestão CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Taxa de Administração 0,20%
Taxa de Performance Não possui
Disponibilidade de Resgate D+0
Quantidade de Cotistas 26
Patrimônio Líquido Fundo 198.418.875,04

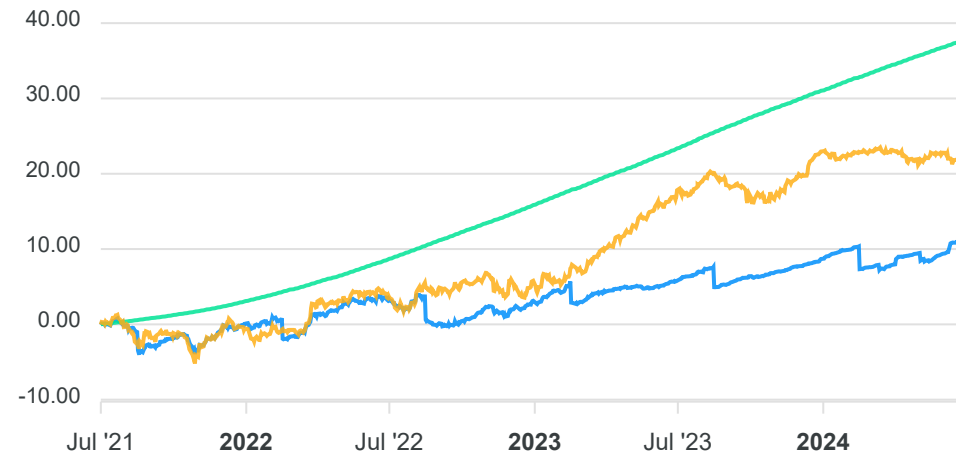
PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark IMA-B
Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento Aplica seus recursos em títulos públicos federais.

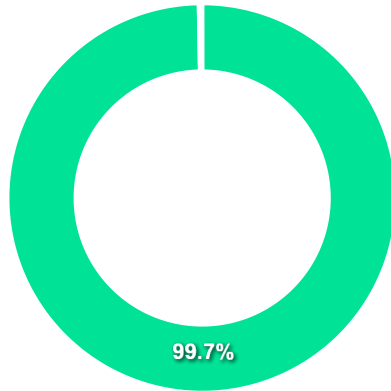
COMPARATIVO

📅 28/06/2024

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,16%	2,76%	2,85%	2,76%	5,47%	7,93%	0,48%	1,02%
Benchmark	-0,97%	-1,10%	-1,27%	-1,10%	3,07%	17,01%		
CDI	0,79%	5,22%	2,53%	5,22%	11,69%	26,82%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	195.595,68	99,72	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	536,49	0,27	Operação compromissada
Outros Valores a receber	17,88	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	11,32	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-12,03	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	195.595,68	99.72%
Operação compromissada	536,49	0.27%
Valores a pagar/receber	17,17	0.01%

Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **INST PREV SEVID ESTADO SERGIPE - SERGIPEPREVIDENCIA - SE** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Junho/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 **INST PREV SEVID ESTADO SERGIPE - SERGIPEPREVIDENCIA - SE** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Junho/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 **INST PREV SEVID ESTADO SERGIPE - SERGIPEPREVIDENCIA - SE** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

