

# 2024

## Relatório Mensal

# Agosto

## 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
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	95.540.763,53	97,28%	11.817.622.756,81	0,81%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.661.583,20	1,69%	4.410.336.954,15	0,04%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.013.449,59	1,03%	20.250.525.135,03	0,01%	7º III a

Investimentos

\$ 98.215.796,32


Disponibilidades Financeiras

\$ 1.238.242,97

Total Carteira

\$ 99.454.039,29

Governança (Pró Gestão)

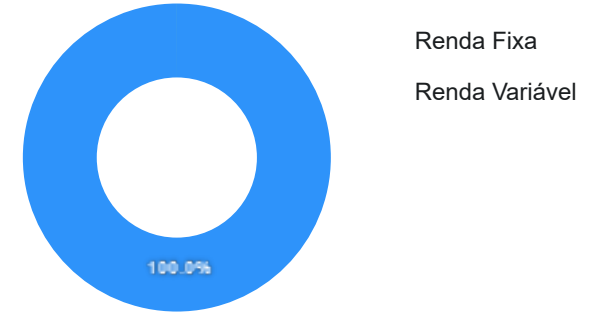
 NIVEL 3 23/11/2024

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Utilizado	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	97,28%	95.540.763,53	2,72%	2.675.032,79
7º III a - FI Referenciados RF	75,00%	2,72%	2.675.032,79	72,28%	70.986.814,45

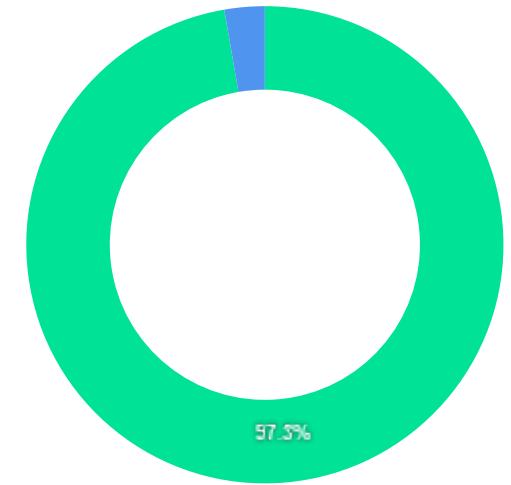
### Governança (Pró Gestão)

[🔍](#) NIVEL 3 23/11/2024

### Segmentos

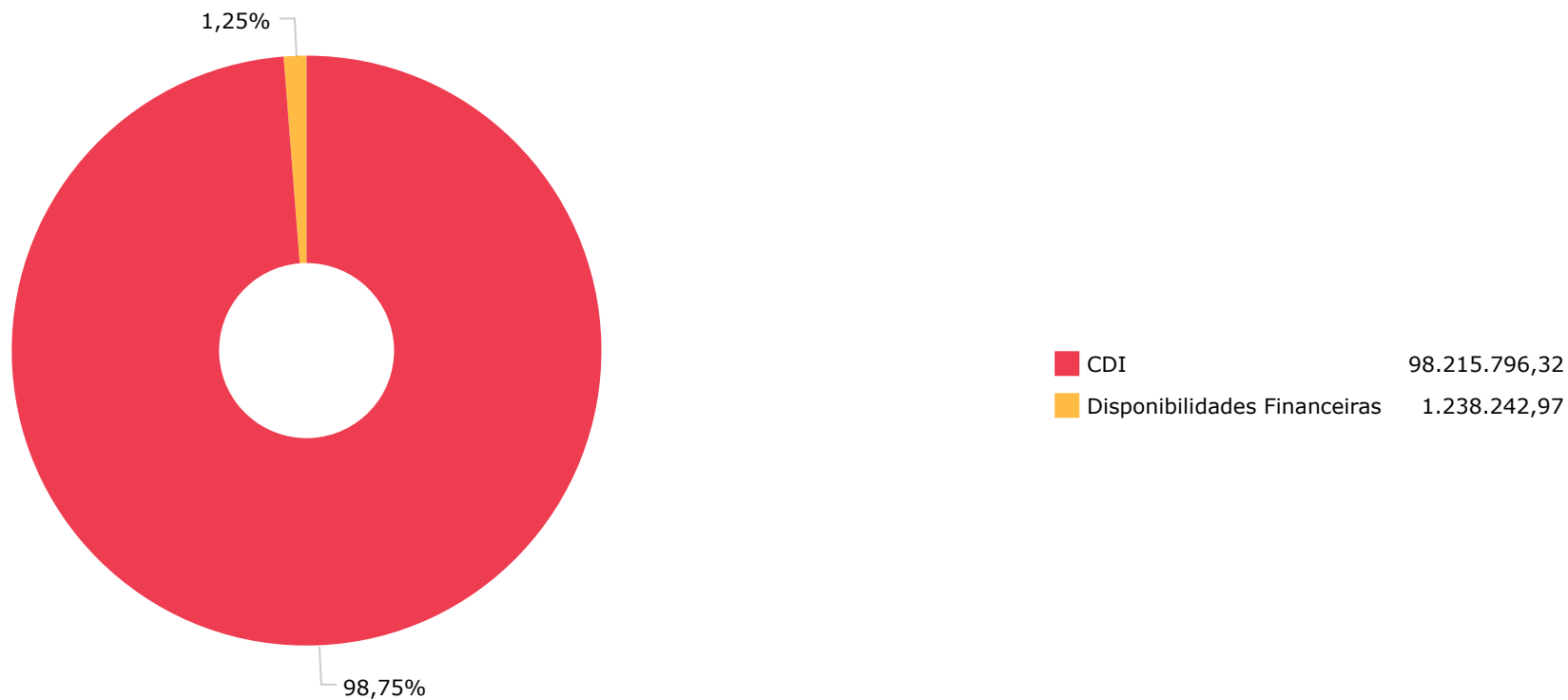


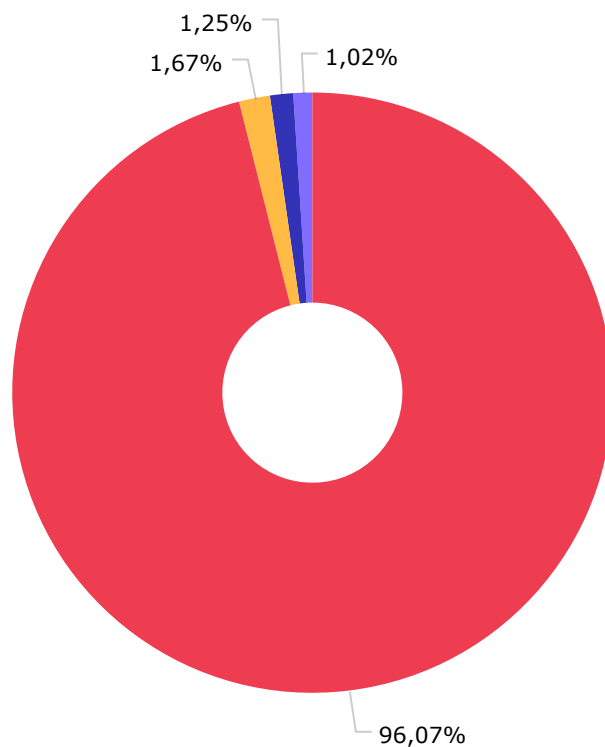
### Artigos



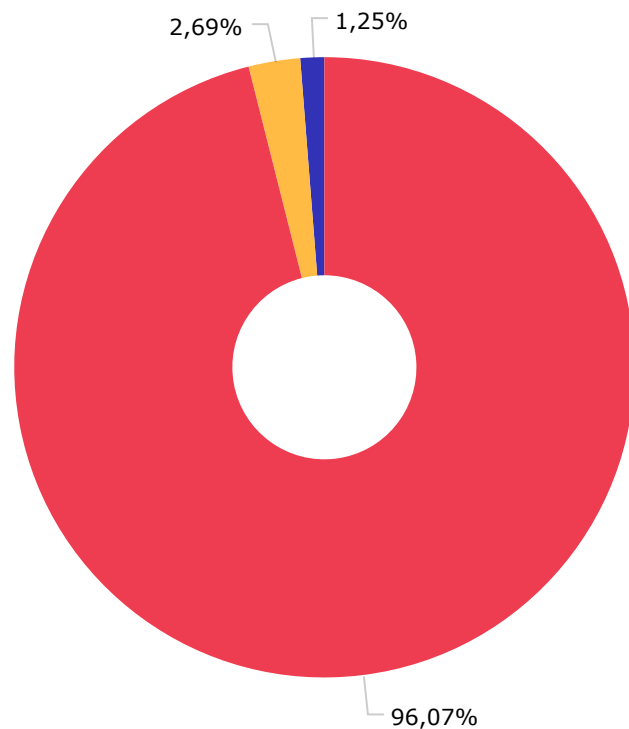
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	98.215.796,32						
7° I b - FI 100% Títulos TN	97,28%	0,00%	79,00%	100,00%	2.675.032,79						
7° III a - FI Referenciados RF	2,72%	0,00%	20,00%	75,00%	70.986.814,45						

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>CDI - BENCHMARK</b>	<b>0,87</b>	<b>7,10</b>	<b>2,58</b>	<b>5,23</b>	<b>11,21</b>	<b>26,28</b>		
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,89	7,21	2,68	5,34	11,32	26,39	0,01	0,02
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86	6,88	2,58	5,04	10,90	25,87	0,04	0,08
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,79	6,39	2,33	4,70	10,11	23,82	0,01	0,02



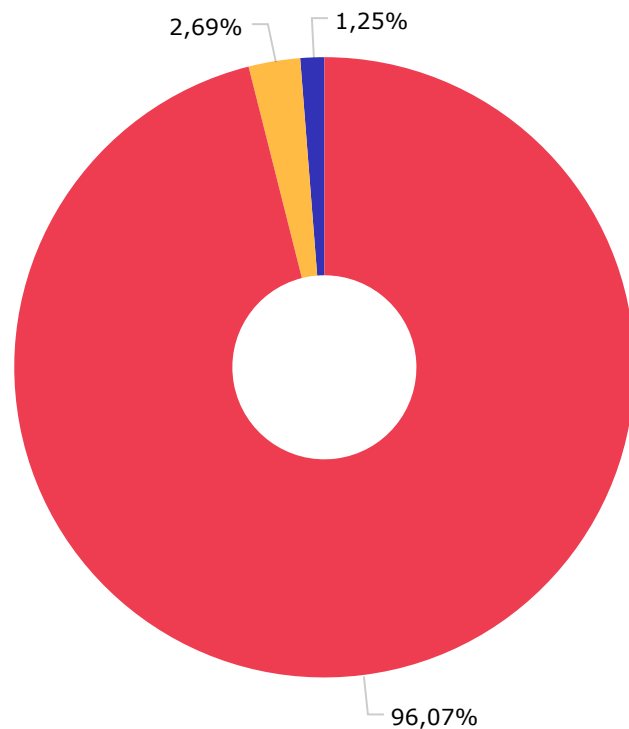


Renda Fixa Duração Livre Soberano	95.540.763,53
Renda Fixa Simples	1.661.583,20
Disponibilidades Financeiras	1.238.242,97
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	1.013.449,59



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	95.540.763,53
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	2.675.032,79
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.238.242,97



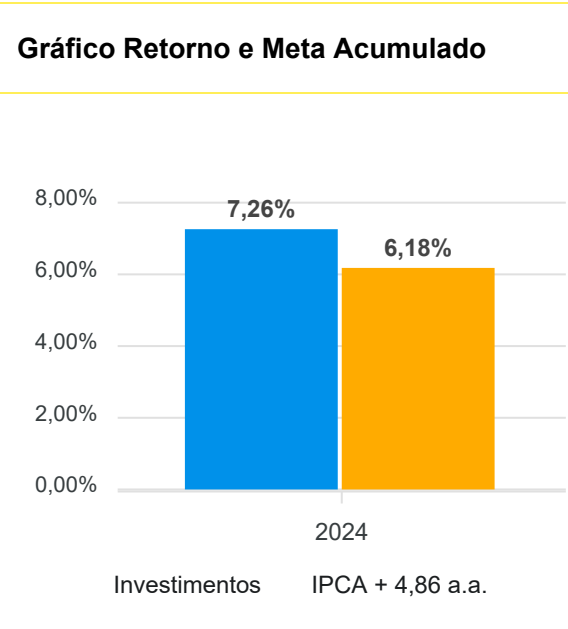


CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	95.540.763,53
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	2.675.032,79
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.238.242,97

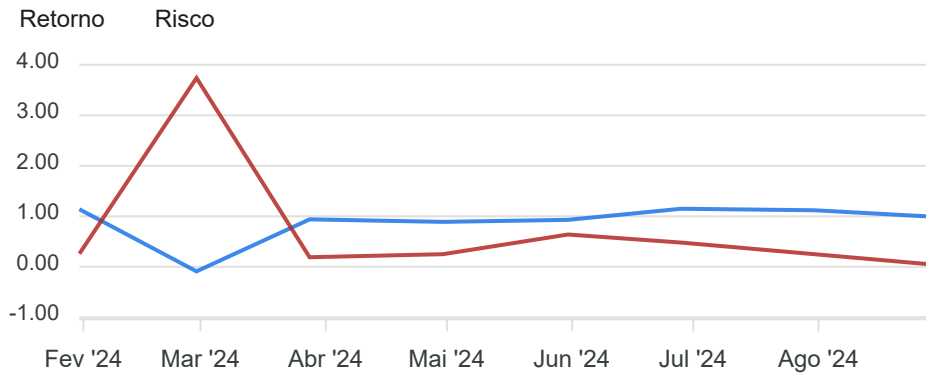
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	128.282.392,38	28.001.200,73	40.001.200,73	117.741.330,05	1.458.937,67	1.458.937,67	1,14% ▲	1,14%	0,84%	0,84%	135,71%	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%
Julho	103.850.399,64	29.358.489,01	27.663.670,12	106.722.256,28	1.177.037,75	6.569.228,51	1,12% ▲	6,21%	0,82%	5,76%	107,81%	0,25%
Agosto	106.722.256,28	153.673.954,27	163.238.246,98	98.215.796,32	1.057.832,75	7.627.061,26	0,99% ▲	7,26%	0,40%	6,18%	117,48%	0,04%

Retorno Acumulado (Períodos)

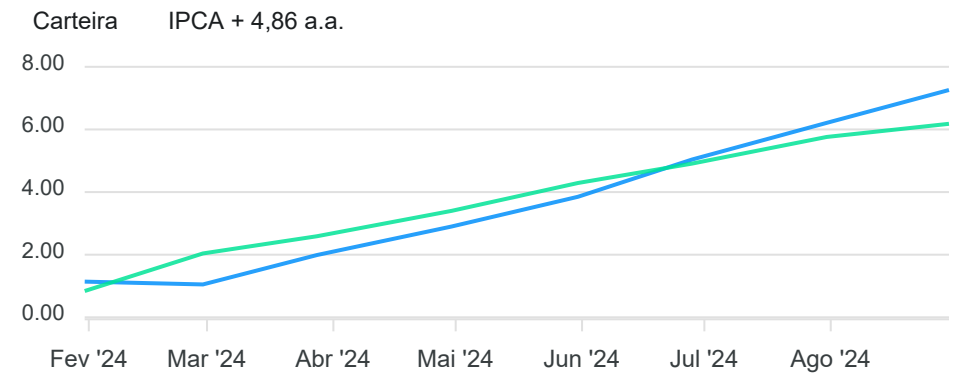
Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	2.442.606,75	1,99%	2,59%
2º Trim	2.949.584,01	2,99%	2,26%
1º Sem	5.392.190,76	5,04%	4,91%



**Gráfico Risco x Retorno**

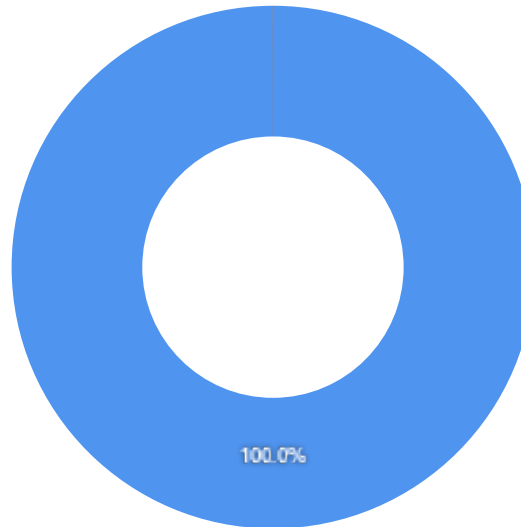


**Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade**



**Liquidez - 30/08/2024**

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	99.454.039,29	101,26
Até D+180	0,00	0,00
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 FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.859.419,03	23.666.162,57	23.894.797,35	1.661.583,20	30.798,95	0,12% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.175.721,00	0,00	10.234.850,05	0,00	59.129,05	0,58% ▲	0,08%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.691.339,10	0,00	9.742.910,15	0,00	51.571,05	0,53% ▲	-
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.845.092,42	0,00	3.865.276,16	0,00	20.183,74	0,52% ▲	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	46.471.185,33	0,00	46.720.368,31	0,00	249.182,98	0,54% ▲	-
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	34.679.499,40	0,00	34.862.505,20	0,00	183.005,80	0,53% ▲	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	34.816.731,88	33.917.539,76	1.013.449,59	114.257,47	0,33% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	95.191.059,82	0,00	95.540.763,53	349.703,71	0,37% ▲	0,04%
	106.722.256,28	153.673.954,27	163.238.246,98	98.215.796,32	1.057.832,75	0,99%	0,04%

## 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 **Agosto/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 **Agosto/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.