

2024

Relatório Mensal

Outubro

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 TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	31.281.281,58	31,42%	11.904.285.539,21	0,26%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	48.633.567,55	48,85%	11.268.222.308,52	0,43%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	19.633.177,64	19,72%	20.409.457.658,47	0,10%	7º III a

Investimentos

\$ 99.548.026,77


Disponibilidades Financeiras

\$ 1.189.214,40

Total Carteira

\$ 100.737.241,17

Governança (Pró Gestão)

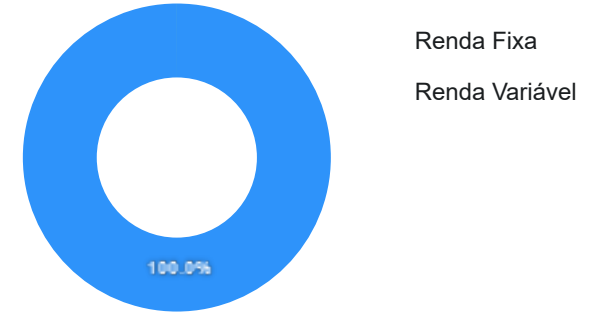
 NIVEL 3 23/11/2024

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Utilizado	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	80,28%	79.914.849,13	19,72%	19.633.177,64
7º III a - FI Referenciados RF	75,00%	19,72%	19.633.177,64	55,28%	55.027.842,44

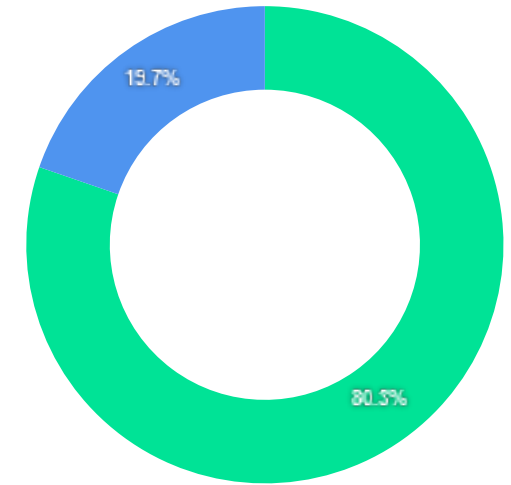
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) NIVEL 3 23/11/2024

Segmentos

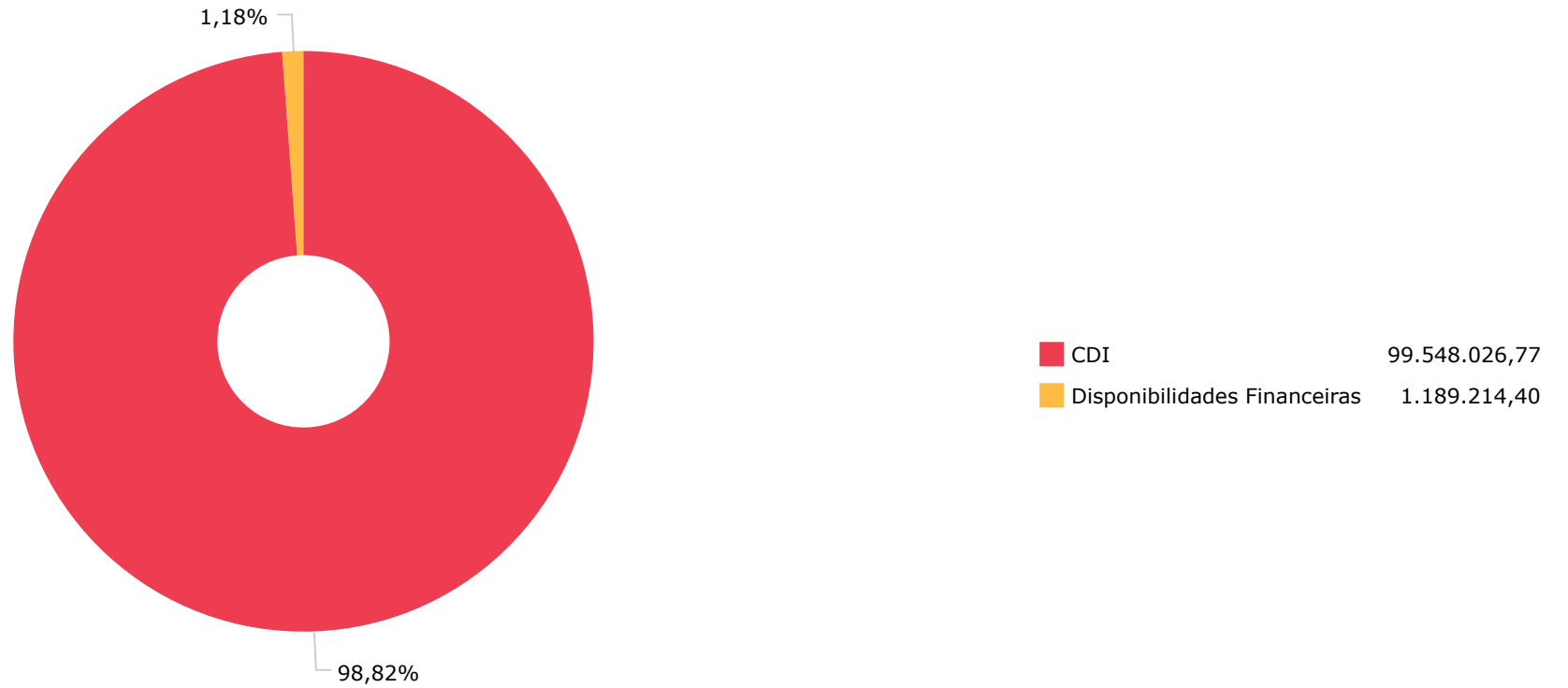


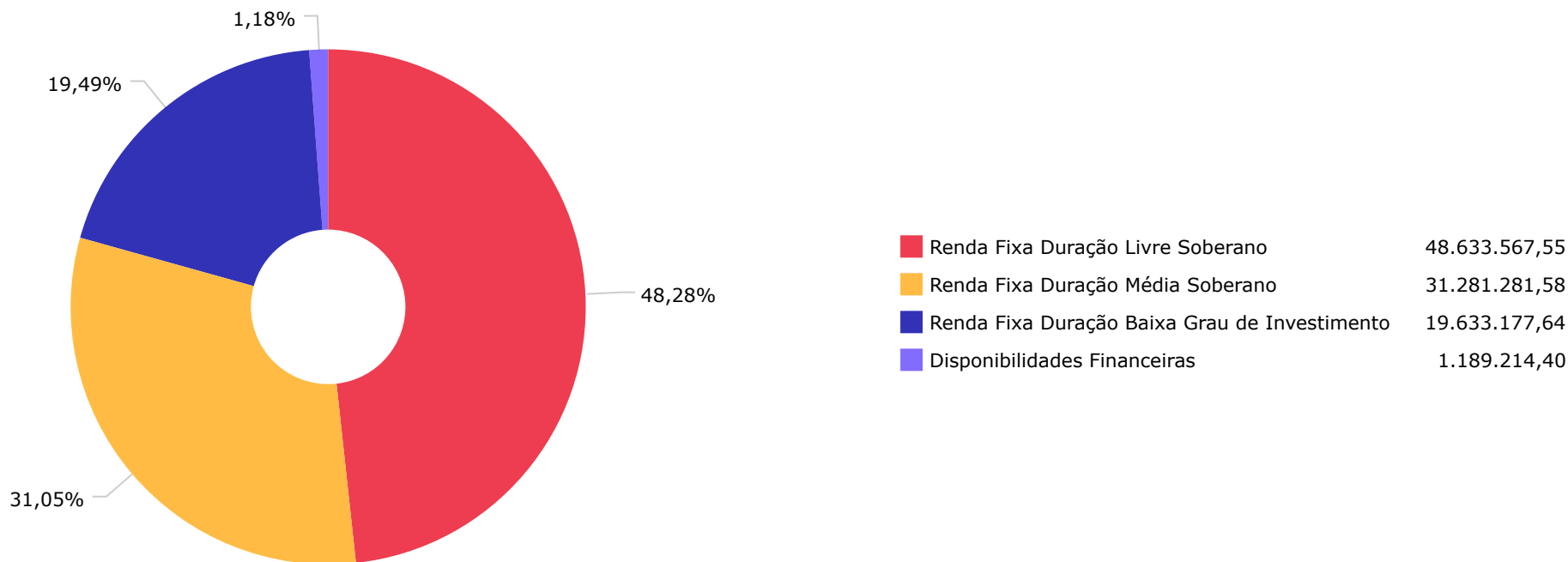
Artigos

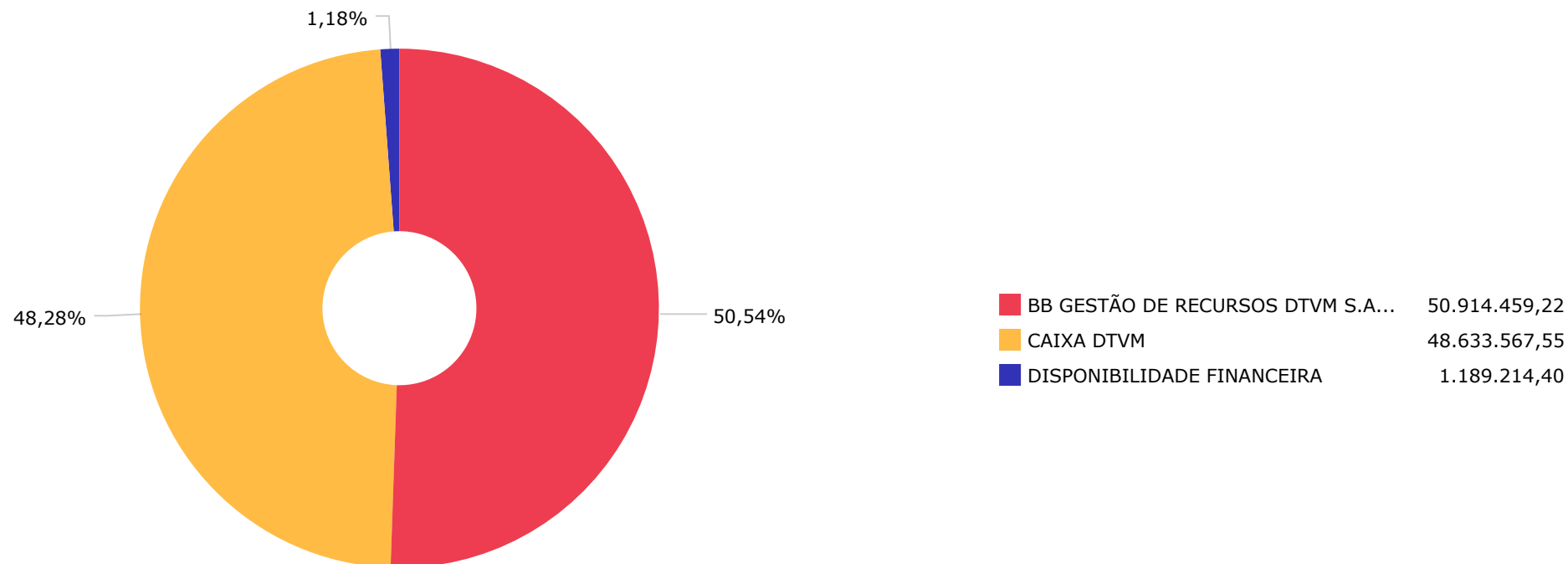


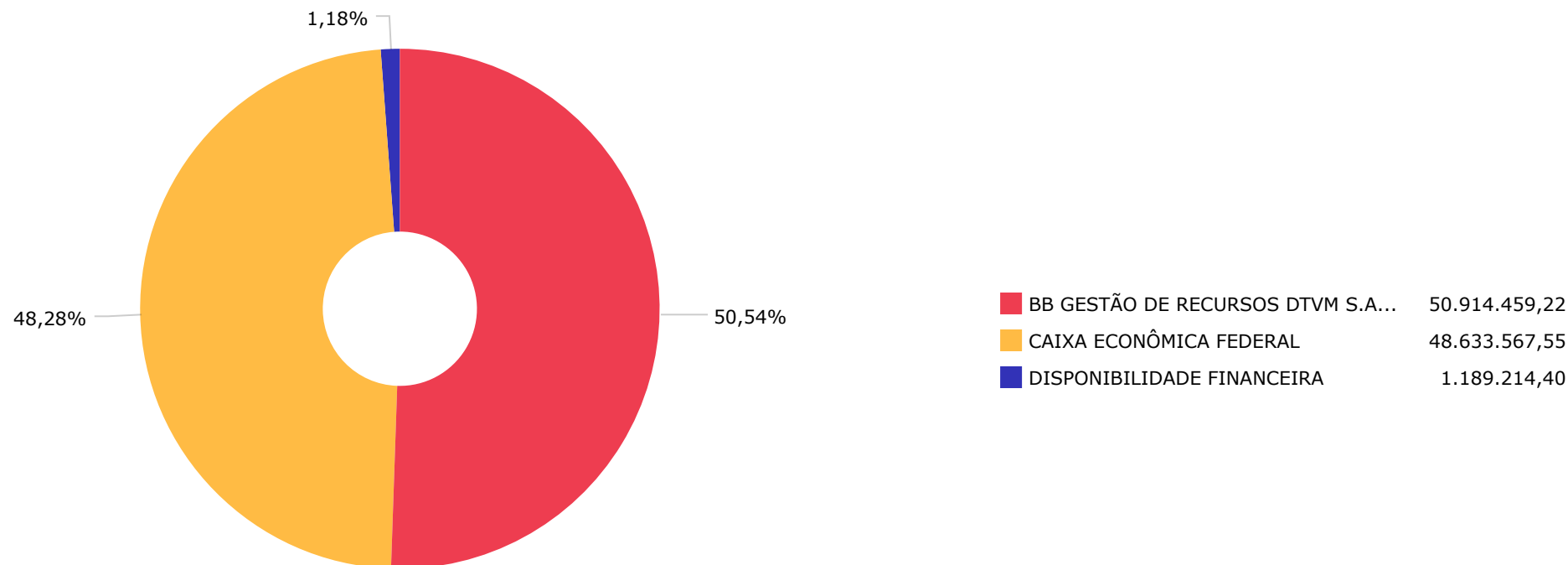
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	99.548.026,77						
7° I b - FI 100% Títulos TN	80,28%	0,00%	79,00%	100,00%	19.633.177,64						
7° III a - FI Referenciados RF	19,72%	0,00%	20,00%	75,00%	55.027.842,44						

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87		
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,93	9,12	2,69	5,38	11,11	25,94	0,02	0,05
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95	8,79	2,67	5,24	10,77	25,47	0,06	0,13
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	0,91	8,79	2,60	5,15	10,72	25,23	0,02	0,05









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%
Setembro	98.215.796,32	110.553.899,39	111.190.577,25	98.474.768,14	895.649,68	8.522.710,94	0,91% ▲	8,24%	0,84%	7,07%	116,55%	0,01%
Outubro	98.474.768,14	44.186.871,49	44.085.879,49	99.548.026,77	972.266,63	9.494.977,57	0,99% ▲	9,31%	1,00%	8,14%	114,37%	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%
3º Trim	3.130.520,18	3,05%	2,06%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

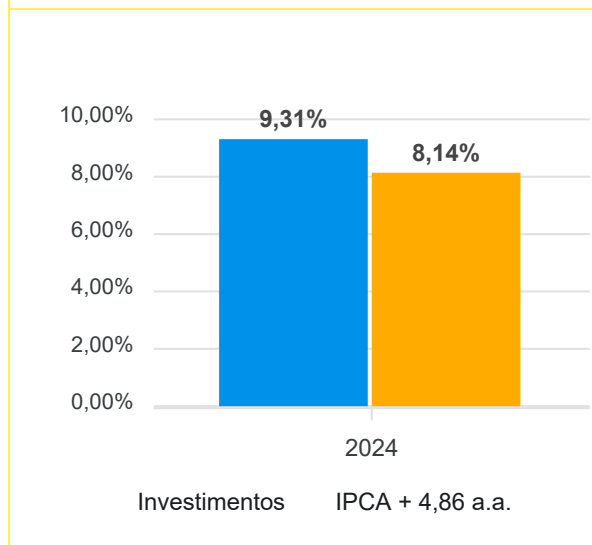


Gráfico Risco x Retorno

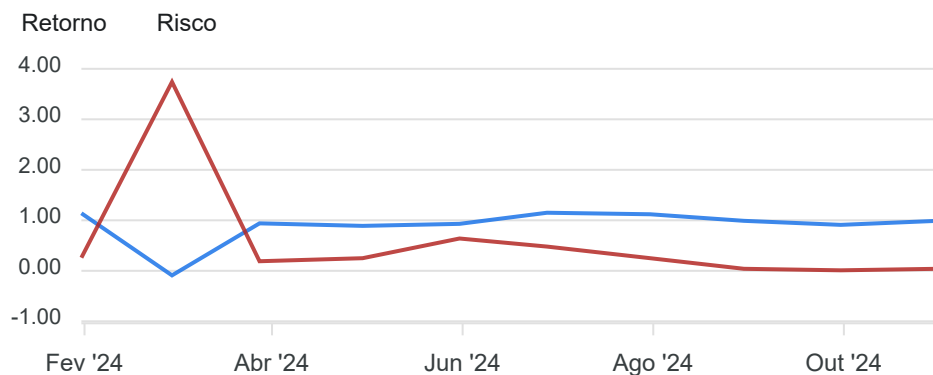
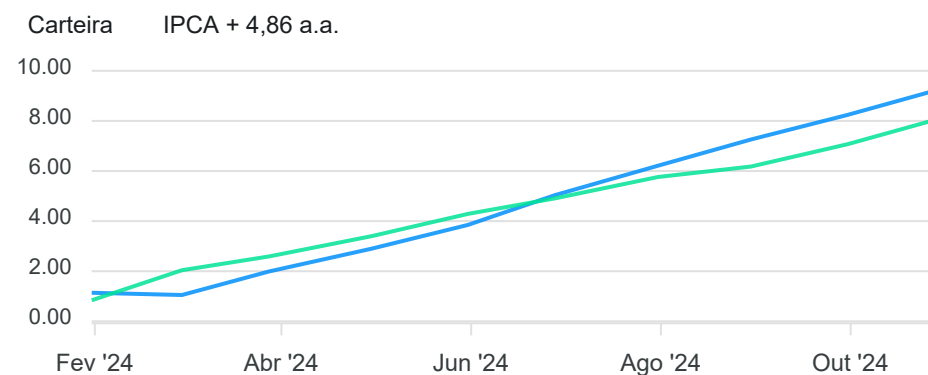
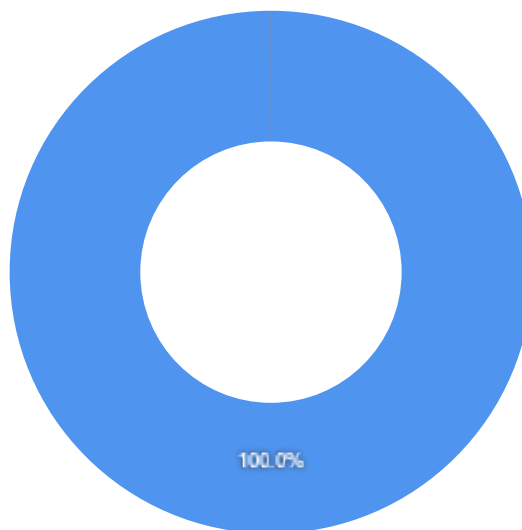


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/10/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	100.737.241,17	100,00
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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	18.287.526,07	15.186.871,49	14.080.000,00	19.633.177,64	238.780,08	0,71% ▲	0,02%
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	32.012.620,28	14.000.000,00	15.000.000,00	31.281.281,58	268.661,30	0,58% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	48.174.621,79	0,00	0,00	48.633.567,55	458.945,76	0,95% ▲	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	15.000.000,00	15.005.879,49	0,00	5.879,49	0,04% ▲	0,03%
	98.474.768,14	44.186.871,49	44.085.879,49	99.548.026,77	972.266,63	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 **Outubro/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 **Outubro/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.