

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 Pro-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.5 Nível 1, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.



Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.707.893,84	4,39%	5.319.492.629,16	0,05%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.400.536,65	5,51%	4.867.666.132,44	0,07%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.011.580,36	4,88%	4.414.843.191,53	0,07%	7º I b
BB IRE-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.497.047,57	28,36%	8.469.459.153,05	0,21%	7º I b
BB IRE-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	974.250,53	1,58%	3.548.363.735,09	0,03%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.084.500,63	3,38%	392.787.249,14	0,53%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.766.820,44	2,86%	7.132.951.786,05	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.380.671,39	2,24%	3.888.604.125,92	0,04%	7º I b
CAIXA BRASIL IRE-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.567.976,27	4,16%	8.028.368.624,38	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	798.000,14	1,29%	11.817.622.756,81	0,01%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	157.393,78	0,26%	1.868.959.978,30	0,01%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	60.088,56	0,10%	1.071.762.033,53	0,01%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	7.048.301,57	11,42%	4.410.336.954,15	0,16%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	10.437.365,84	16,92%	20.250.525.135,03	0,05%	7º III a
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.134.724,78	1,84%	12.462.304.009,21	0,01%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.297.555,68	6,97%	15.057.333.281,43	0,03%	7º III a
BB AGRO FIC AÇÕES	229.179,13	0,37%	246.284.706,97	0,09%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	665.840,85	1,08%	822.113.263,16	0,08%	8º I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	423.983,35	0,69%	1.149.370.153,49	0,04%	8º I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	130.142,71	0,21%	822.702.839,69	0,02%	8º I
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	265.788,87	0,43%	797.695.836,05	0,03%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	67.051,32	0,11%	611.995.647,76	0,01%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	126.311,29	0,20%	2.663.493.555,95	0,00%	9º III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	458.979,96	0,74%	1.381.106.413,32	0,03%	10º I

Investimentos

\$ 61.691.985,51

Disponibilidades Financeiras

\$ 2.760.187,27

Total Carteira

\$ 64.452.172,78

Governança (Pró Gestão)

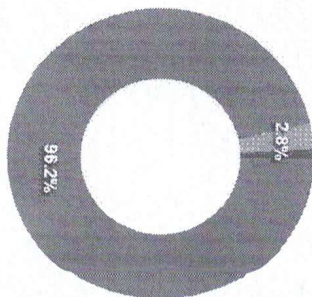
29 NIVEL 2 29/09/2024

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	59,01%	36.406.760,16 40,99%
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	37,15%	22.917.947,87 32,85%
8º I - Fundos de Ações	40,00%	2,78%	1.714.934,91 37,22%
9º III - Ações - BDR Nivel I	10,00%	0,31%	193.362,61 9,69%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	0,74%	458.979,96 9,26%
			5.710.218,59

Governança (Pró Gestão)

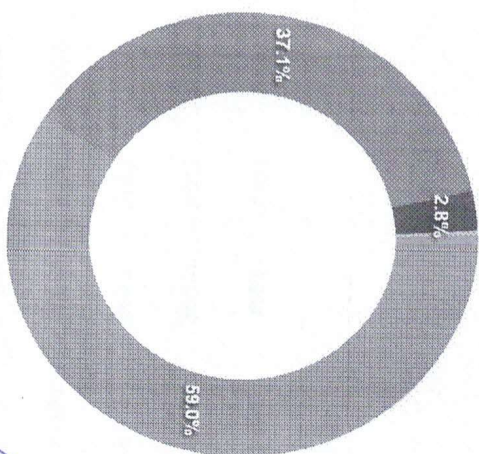
29 NIVEL 2 29/09/2024

Segmentos



Renda Fixa
Renda Variável
Exterior
Estruturados

Artigos



(Handwritten signatures)

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	61.691.985,51	8º I - Fundos de Ações	2,78%	0,00%	10,00%	40,00%	22.961.859,29
7º I b - FI 100% Títulos TN	59,01%	0,00%	60,00%	100,00%	25.285.225,35	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	24.676.794,20
7º III a - FI Referenciados RF	37,15%	0,00%	19,00%	70,00%	20.266.441,99	9º III - Ações - BDR Nível I	0,31%	0,00%	2,00%	10,00%	5.975.835,94
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	37.015.191,31	10º I - Fundos Multimercados	0,74%	0,00%	1,00%	10,00%	5.710.218,59
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	12.338.397,10	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.084.599,28
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	6.169.198,55						
7º V b - Fundos de RF - Credit...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	6.169.198,55						
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	6.169.198,55						

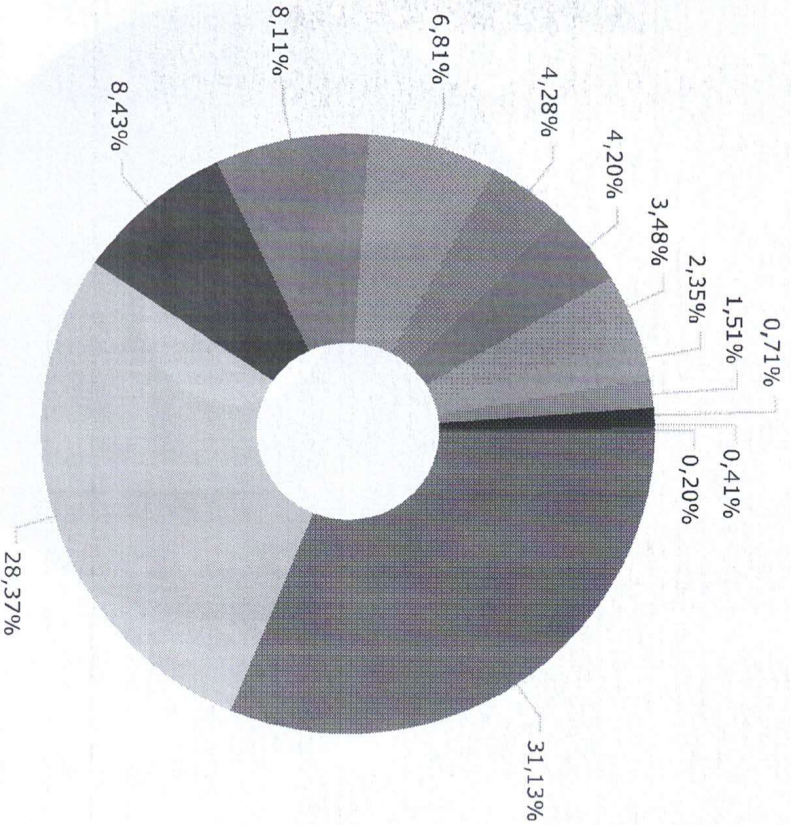
Mais Valia Consultoria Ltda EPP

Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)996146774 / (21)99739-9777

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	0,01	0,02
BB PERFL 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
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	0,55	42,25	13,74	27,72	48,00	71,14		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,57	41,02	13,95	26,91	46,38	68,28	9,23	19,43
IBOVESPA - BENCHMARK	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18		
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,80	26,47	6,26	12,15	37,48	61,60	11,09	23,36
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9,54	2,74	10,19	3,26	17,40	26,11	7,33	15,45
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	6,80	2,47	10,02	1,71	13,82	26,58	6,07	12,78
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	4,68	-4,65	9,30	1,39	9,11	10,30	5,93	12,49
BB AGRO FIC AÇÕES	4,62	-1,27	8,10	3,49	8,20	5,46	8,31	17,51
IBX - BENCHMARK	6,60	1,79	11,34	5,58	18,00	22,90		
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	4,64	2,51	9,46	4,31	12,73	15,54	7,35	15,48
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,60	4,60	1,53	3,33	7,94	20,67		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64	4,56	1,66	3,36	7,81	20,28	1,25	2,63
IMA-B - BENCHMARK	0,52	1,49	1,63	1,40	5,32	19,81		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50	1,33	1,56	1,26	5,08	19,27	2,44	5,13
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46	1,29	1,54	1,24	5,04	19,17	2,43	5,11
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,59	4,88	1,91	3,56	8,14	21,08		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58	4,74	1,86	3,45	7,91	20,66	1,09	2,29

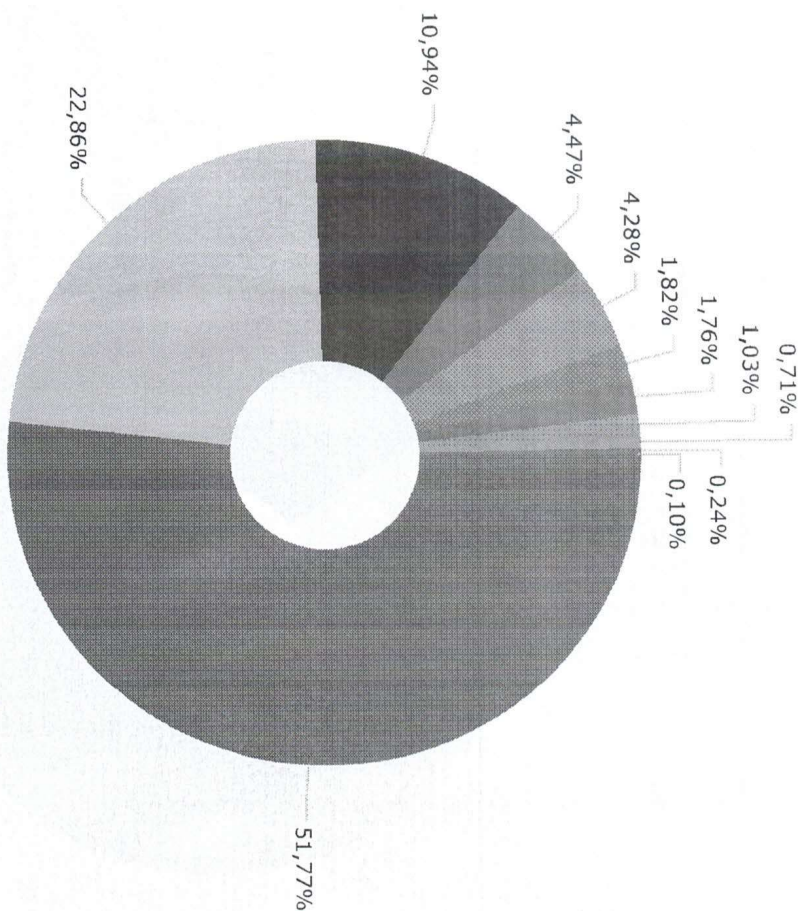
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var - Mes	Volatilidade - Mes
SANTANDER IMA-B-5 PREMIUM FIC RENDA FIXA								
	0,57	4,71	1,85	3,44	7,88	20,53	1,09	2,29
BB IMA-B-5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP								
	0,52	4,66	1,80	3,38	7,84	20,50	1,11	2,34
IPCA - BENCHMARK								
	-0,02	2,85	0,57	1,58	4,24	9,04		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO								
	0,92	7,74	3,09	5,79	11,28	23,62	0,08	0,18
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA								
	0,70	3,53	1,38	2,47	7,38	21,12	0,69	1,46
IRF-M - BENCHMARK								
	0,66	3,54	1,70	2,39	8,26	24,46		
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO								
	0,65	3,37	1,66	2,25	8,00	23,62	1,62	3,41
IRF-M 1 - BENCHMARK								
	0,77	6,30	2,36	4,62	10,39	25,57		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA								
	0,75	6,24	2,30	4,51	10,24	25,14	0,30	0,64
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO								
	0,74	6,13	2,27	4,45	10,09	24,84	0,30	0,64
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK								
	2,28	18,42	7,03	10,83	25,31	42,82		
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO								
	2,48	21,30	8,02	12,90	30,96	61,90	9,24	19,47
SELIC - BENCHMARK								
	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28		
BRADESCO PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI								
	0,91	7,71	2,77	5,61	12,12	27,88	0,04	0,08
BRADESCO FEDERAL EXTRA FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI								
	0,86	6,94	2,55	5,12	10,93	25,66	0,01	0,02





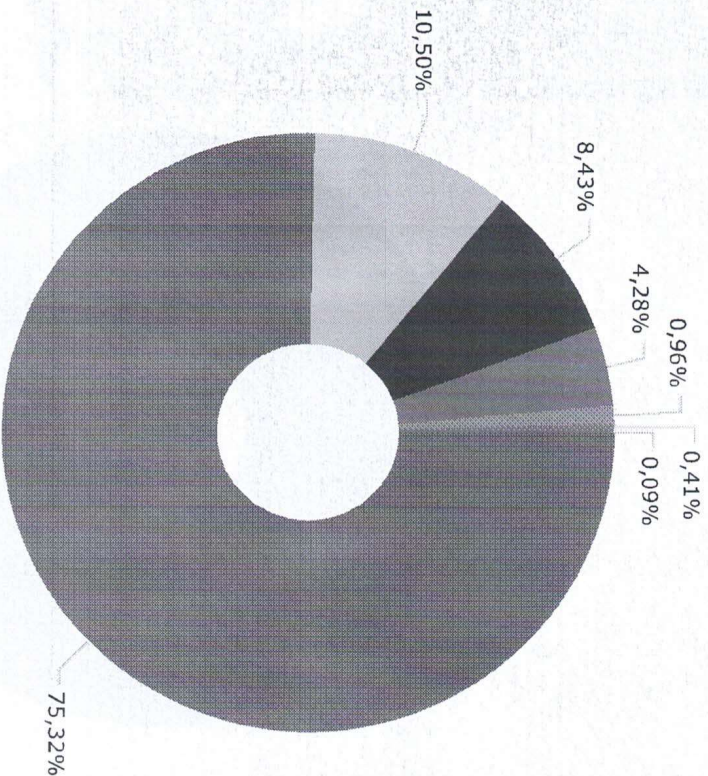
IRF-M 1	20.065.023,84
CDI	18.283.667,55
Selic	5.432.280,46
IMA-B 5	5.227.445,65
IMA-B	4.392.251,75
Disponibilidades Financeiras	2.760.187,27
IDKA IPCA 2 Anos	2.707.893,84
IPCA	2.241.894,41
Ibovespa	1.516.197,36
IRF-M	974.250,53
S&P 500 (Moeda Original)	458.979,96
IBX	265.788,87
Global BDRX	126.311,29

[Handwritten signatures]



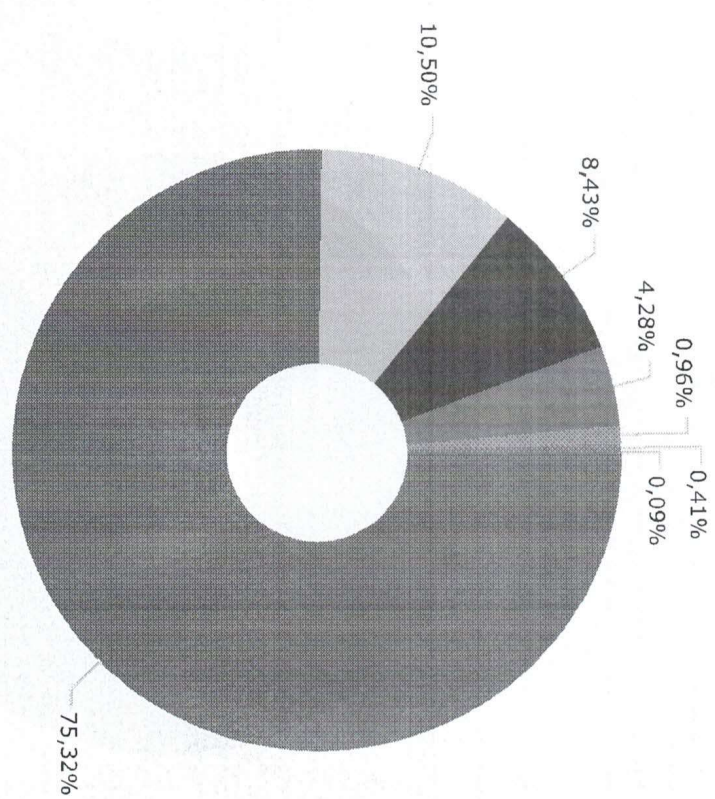
Renda Fixa Indexados	33.366.865,61
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	14.734.921,52
Renda Fixa Simples	7.048.301,57
Renda Fixa Duração Livre Soberano	2.882.500,77
Disponibilidades Financeiras	2.760.187,27
Ações Livre	1.175.405,35
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	1.134.724,78
Ações Dividendos	665.840,85
Multimercados Estratégia Específica	458.979,96
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	157.393,78
Ações Setoriais	67.051,32

[Handwritten signatures]



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A....	48.547.531,64
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.769.922,24
BRAM - BRADESCO ASSET MANEGEME...	5.432.280,46
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.760.187,27
ITAU UNIBANCO S.A.	616.373,74
CLARITAS ADMINISTRAÇÃO DE RECU...	265.788,87
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	60.088,56

[Handwritten signatures]



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	48.547.531,64
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.769.922,24
BANCO BRADESCO S.A.	5.432.280,46
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.760.187,27
ITAU UNIBANCO S.A.	616.373,74
S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA...	265.788,87
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	60.088,56

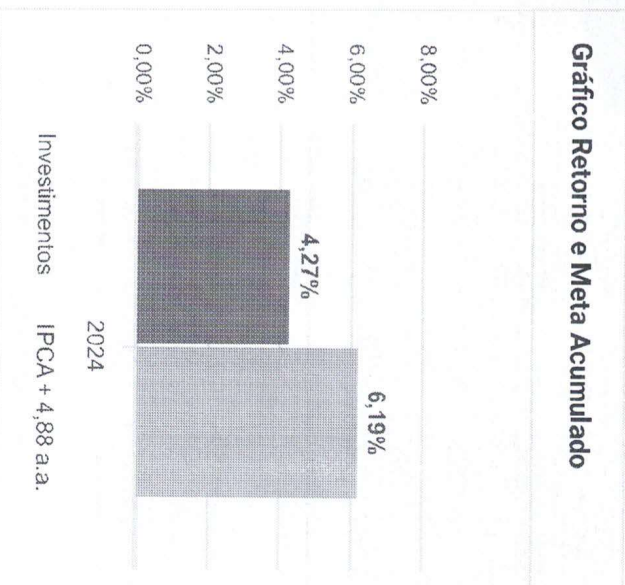
(Handwritten signatures)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	47.918.729,58	924.649,30	0,00	48.864.986,03	21.607,15	21.607,15	0,04% ▲	0,04%	0,84%	0,84%	4,76%	1,28%
Fevereiro	48.864.986,03	846.140,28	66.758,87	50.063.541,08	419.173,64	440.780,79	0,84% ▲	0,89%	1,19%	2,04%	43,63%	1,11%
Março	50.063.541,08	2.576.365,94	0,00	52.877.996,69	238.089,67	678.870,46	0,45% ▲	1,35%	0,54%	2,59%	52,12%	1,05%
Abril	52.877.996,69	7.603.018,32	7.603.018,41	52.621.357,42	-256.639,18	422.231,28	-0,49% ▼	0,85%	0,80%	3,41%	24,93%	1,17%
Maior	52.621.357,42	3.576.156,90	174.191,20	56.552.517,60	529.194,48	951.425,76	0,94% ▲	1,81%	0,86%	4,30%	42,09%	0,91%
Junho	56.552.517,60	0,00	30.927,36	56.757.049,59	235.459,35	1.186.885,11	0,42% ▲	2,23%	0,59%	4,92%	45,33%	1,16%
Julho	56.757.049,59	19.079.960,52	15.351.268,99	61.142.476,53	666.735,41	1.843.620,52	1,09% ▲	3,34%	0,82%	5,77%	57,89%	0,65%
Agosto	61.142.476,53	393.094,90	392.464,26	61.691.985,51	548.878,34	2.392.498,86	0,90% ▲	4,27%	0,40%	6,19%	68,98%	0,74%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	678.870,46	1,35%	2,59%
2º Trim	508.014,65	0,87%	2,26%
1º Sem	1.186.885,11	2,23%	4,92%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado



(Handwritten signatures)

Gráfico Risco x Retorno

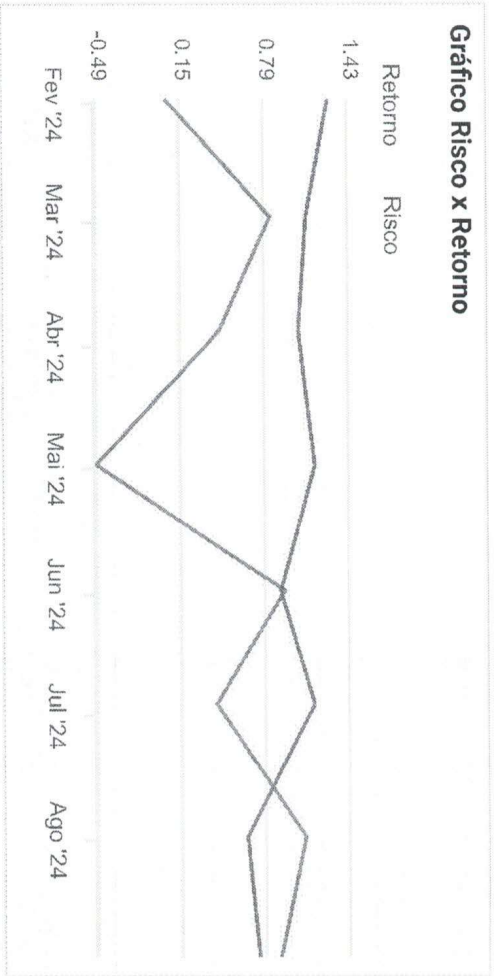
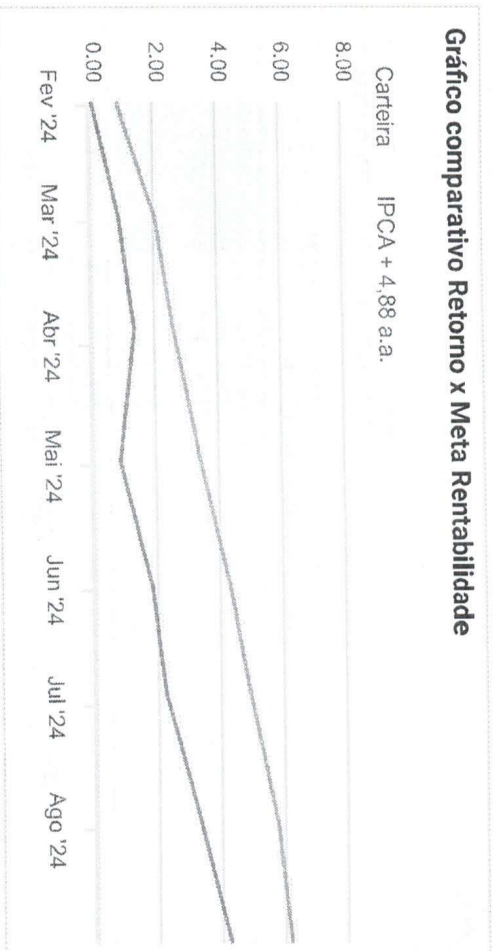
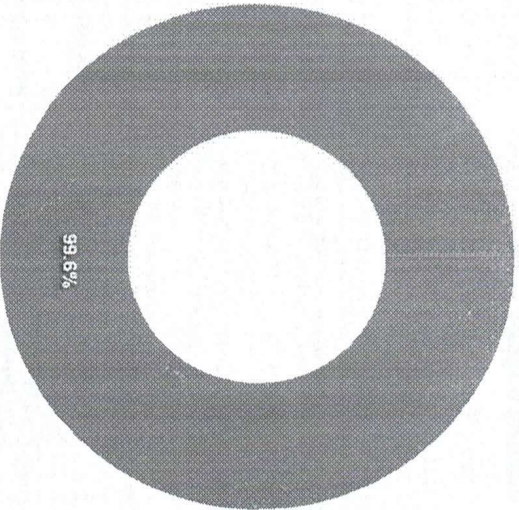


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/08/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	64.186.383,91	104,04
Até D+180	265.788,87	0,43
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



[Handwritten signatures]

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - Var
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	6.993.394,42	0,00	0,00	7.048.301,57	54.907,15	0,79% ▲	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.690.796,11	0,00	0,00	2.707.893,84	17.097,73	0,64% ▲	1,25%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.382.981,12	0,00	0,00	3.400.536,65	17.555,53	0,52% ▲	1,11%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.997.713,27	0,00	0,00	3.011.580,36	13.867,09	0,46% ▲	2,43%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.368.008,14	0,00	0,00	17.497.047,57	129.039,43	0,74% ▲	0,30%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	967.941,63	0,00	0,00	974.250,53	6.308,90	0,65% ▲	1,62%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	10.345.111,58	0,00	0,00	10.437.365,84	92.254,26	0,89% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.065.441,71	0,00	0,00	2.084.500,63	19.058,92	0,92% ▲	0,08%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.125.031,17	0,00	0,00	1.134.724,78	9.693,61	0,86% ▲	0,01%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.258.605,36	0,00	0,00	4.297.555,68	38.950,32	0,91% ▲	0,04%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	390.371,05	0,00	392.464,26	0,00	2.093,21	0,54% ▲	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.756.620,99	0,00	0,00	1.766.820,44	10.199,45	0,58% ▲	1,09%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.373.809,50	0,00	0,00	1.380.671,39	6.861,89	0,50% ▲	2,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.548.899,72	0,00	0,00	2.567.976,27	19.076,55	0,75% ▲	0,30%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	401.433,76	393.094,90	0,00	798.000,14	3.471,48	0,44% ▲	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	156.292,12	0,00	0,00	157.393,78	1.101,66	0,70% ▲	0,69%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	59.745,33	0,00	0,00	60.088,56	343,23	0,57% ▲	1,09%
	58.882.196,98	393.094,90	392.464,26	59.324.708,03	441.880,41	0,75%	0,47%



RENDIA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AGRO FIC AÇÕES	219.055,43	0,00	0,00	229.179,13	10.123,70	4,62% ▲	8,31%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	623.418,23	0,00	0,00	665.840,85	42.422,62	6,80% ▲	6,07%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	405.032,74	0,00	0,00	423.983,35	18.950,61	4,68% ▲	5,93%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	118.805,74	0,00	0,00	130.142,71	11.336,97	9,54% ▲	7,33%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	253.998,66	0,00	0,00	265.788,87	11.790,21	4,64% ▲	7,35%
	1.620.310,80	0,00	0,00	1.714.934,91	94.624,11	5,84%	6,63%



ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	447.850,97	0,00	0,00	458.979,96	11.128,99	2,48% ▲	9,24%
	447.850,97	0,00	0,00	458.979,96	11.128,99	2,48%	9,24%


(Handwritten signatures)

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	66.516,73	0,00	0,00	67.051,32	534,59	0,80% ▲	11,09%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	125.601,05	0,00	0,00	126.311,29	710,24	0,57% ▲	9,23%
	192.117,78	0,00	0,00	193.362,61	1.244,83	0,65%	3,85%



Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **IBASMA INST BENEF ASSIST SERV MUNC ARARUAMA - RJ** 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 **IBASMA INST BENF ASSIST SERV MUNC ARARUAMA - RJ** 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 **IBASMA INST BENF ASSIST SERV MUNC ARARUAMA - RJ** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

