

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

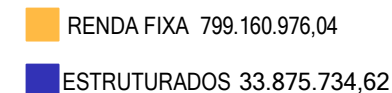
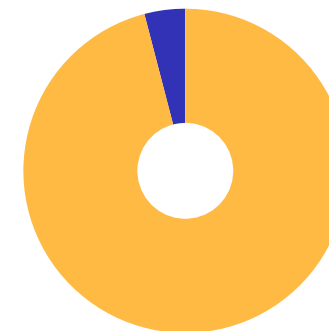
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	175.532.072,51	21,07%	665	2,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.540.767,25	0,55%	594	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	110.646.346,86	13,28%	1.127	1,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	21.863.990,09	2,62%	601	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA F...	D+0	17/08/2026	60.298.083,14	7,24%	362	1,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	9.292.590,55	1,12%	110	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	46.794.763,22	5,62%	720	1,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	111.334.827,66	13,36%	1.157	1,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	14.167.585,42	1,70%	397	0,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	1.694.317,07	0,20%	196	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	28.656.714,42	3,44%	1.037	0,74%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	160.940.049,83	19,32%	1.211	0,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	820.782,41	0,10%	368	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	47.165.014,92	5,66%	1.066	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	Não se ...	27 meses	3.830.621,46	0,46%		12,02%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	787.793,37	0,09%		5,57%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea a
RECUPERAÇÃO BRASIL FI RENDA FIXA LP	D+3 ou ...	90 dias	794.655,86	0,10%	19	19,50%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea b
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	33.875.734,62	4,07%	4.087	2,80%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			833.036.710,66				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			97.388,12				Artigo 6º
		PL Total	833.134.098,78				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2024)

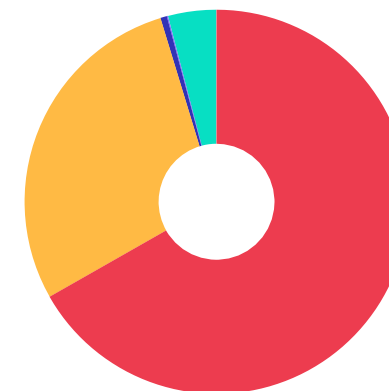
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	100,00%	833.036.710,66
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	556.165.343,77	66,76%	30,00%	35,00%	100,00%	276.871.366,89
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	237.582.561,58	28,52%	10,00%	30,00%	60,00%	262.239.464,82
Artigo 7º, Inciso V, Alínea a	5,00%	4.618.414,83	0,55%	1,00%	2,00%	5,00%	37.033.420,70
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	794.655,86	0,10%	0,00%	0,00%	5,00%	40.857.179,67
Total Renda Fixa	100,00%	799.160.976,04	95,93%	41,00%	77,00%	270,00%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	166.607.342,13
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	33.875.734,62	4,07%	0,00%	10,00%	10,00%	49.427.936,45
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	41.651.835,53
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	41.651.835,53
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	33.875.734,62	4,07%	0,00%	20,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	83.303.671,07
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	83.303.671,07
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	83.303.671,07
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	562.478.024,10	67,52	-
CAIXA DTVM	263.451.298,80	31,63	1,30
GENIAL GESTÃO LTDA	4.618.414,83	0,55	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	1.694.317,07	0,20	0,00
BRZ INVESTIMENTOS	794.655,86	0,10	0,04

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA FIXA

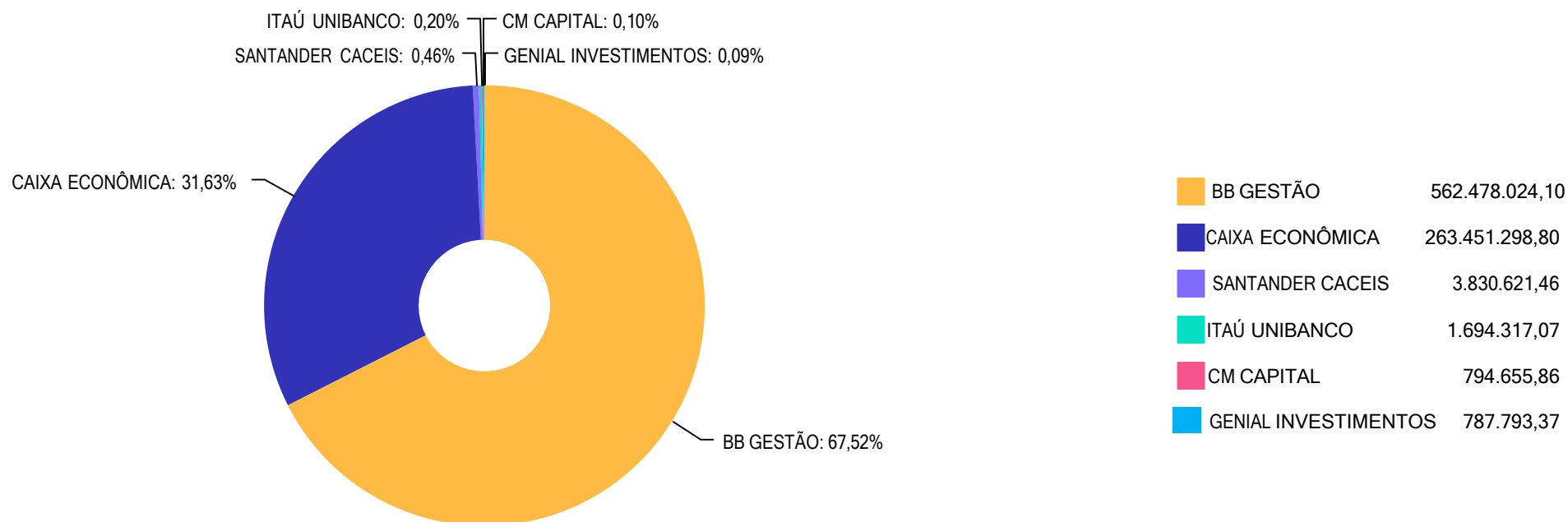
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	0,85%	7,18%	2,04%	4,38%	9,65%	21,10%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	0,50%	-	1,81%	-	-	-	0,80%	-
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,12%	10,83%	3,52%	7,05%	14,94%	34,96%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-4,68%	1.071,01%	-2,38%	-46,34%	40,85%	2.415,81%	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,82%	7,18%	2,55%	4,60%	10,28%	25,21%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,81%	7,10%	2,50%	4,52%	10,13%	24,79%	0,14%	0,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	6,98%	2,47%	4,44%	9,98%	24,49%	0,14%	0,41%
IMA-B (Benchmark)	-0,67%	0,82%	1,94%	0,64%	5,61%	17,28%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,69%	0,60%	1,84%	0,49%	5,34%	16,66%	1,86%	3,95%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,55%	-4,45%	-1,02%	-2,08%	-0,44%	4,55%	2,06%	5,78%
RECUPERAÇÃO BRASIL FI RENDA FIXA LP	-3,20%	-20,75%	-2,52%	-13,75%	-15,34%	-62,80%	2,61%	11,15%
IRF-M (Benchmark)	0,34%	3,90%	2,36%	2,19%	8,45%	23,17%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	3,70%	2,31%	2,06%	8,19%	22,33%	1,35%	2,72%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,32%	3,70%	2,30%	2,05%	8,19%	22,74%	1,35%	2,72%
CDI (Benchmark)	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA FIXA

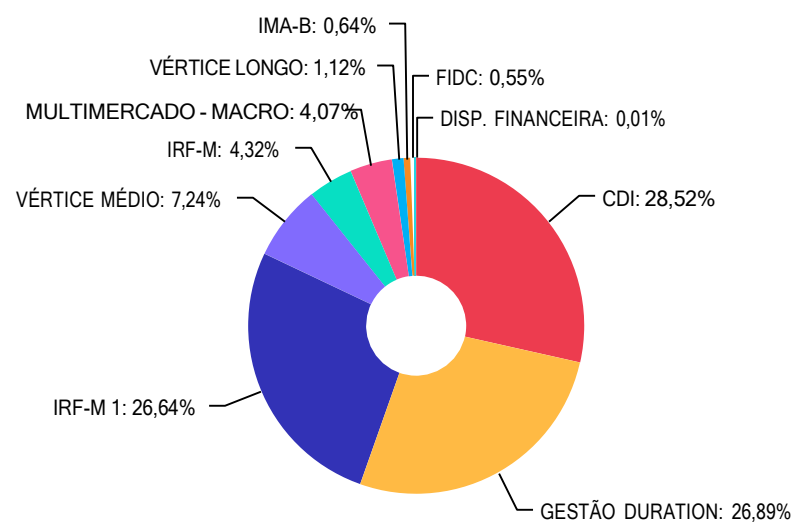
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,86%	8,25%	2,74%	5,38%	11,42%	26,66%	0,02%	0,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	6,66%	2,71%	4,15%	9,77%	24,69%	0,18%	0,65%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,75%	7,17%	2,36%	4,69%	9,95%	22,88%	0,00%	0,04%
BBIF MASTER FIDC LP SÊNIOR 1	-0,61%	-4,25%	-1,48%	-3,02%	-5,76%	13,90%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,84%	8,11%	2,73%	5,33%	11,17%	26,08%	0,01%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75%	7,19%	2,38%	4,70%	9,96%	23,52%	0,01%	0,05%
IPCA (Benchmark)	0,44%	3,31%	0,80%	1,86%	4,42%	9,84%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,53%	4,59%	2,18%	2,74%	7,65%	21,45%	0,56%	1,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,63%	4,18%	2,23%	2,55%	8,39%	20,05%	0,50%	2,39%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,83%	7,99%	2,63%	5,23%	11,06%	25,98%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,09%	4,73%	2,78%	2,91%	9,84%	21,02%	1,22%	3,11%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2024)

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2024)

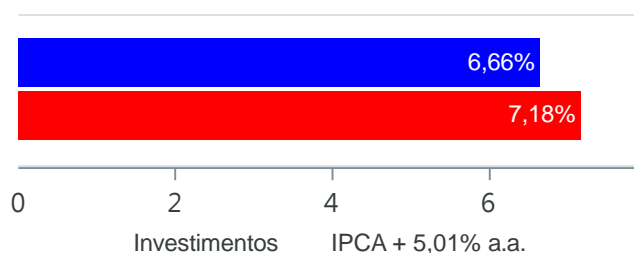


■ CDI	237.582.561,58	■ GESTÃO DURATION	224.021.152,80	■ IRF-M 1	221.981.174,52	■ VÉRTICE MÉDIO	60.298.083,14
■ IRF-M	36.031.575,51	■ MULTIMERCADO - MACRO	33.875.734,62	■ VÉRTICE LONGO	9.292.590,55	■ IMA-B	5.335.423,11
■ FIDC	4.618.414,83	■ DISP. FINANCEIRA	97.388,12				

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

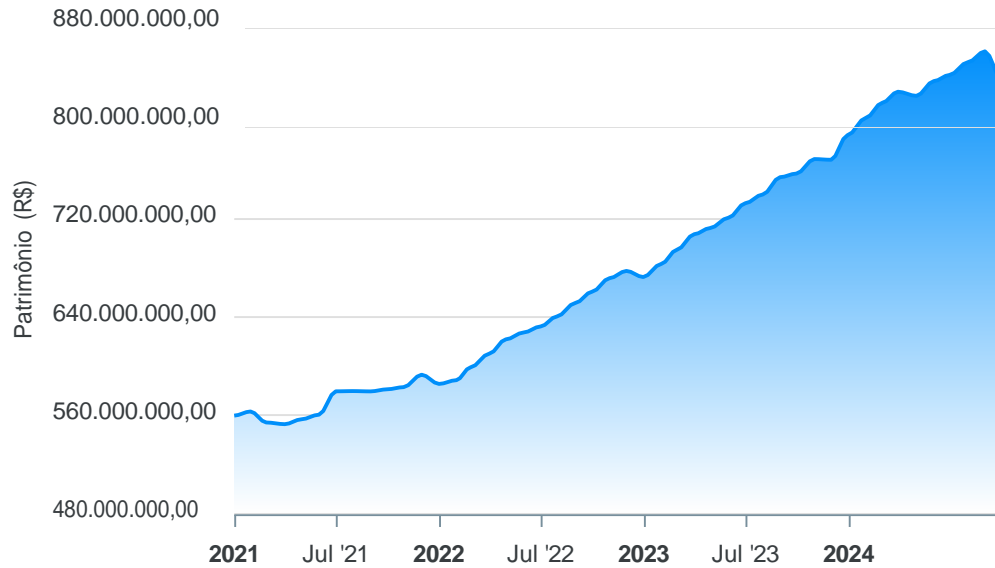
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	788.435.283,80	41.405.150,98	33.556.920,55	802.668.106,11	6.384.591,88	6.384.591,88	0,80%	0,80%	0,85%	0,85%	94,39%	0,22%
Fevereiro	802.668.106,11	34.348.126,37	27.828.272,11	814.905.694,53	5.717.734,16	12.102.326,04	0,71%	1,51%	1,20%	2,06%	73,43%	0,22%
Março	814.905.694,53	15.868.338,45	14.207.630,14	823.950.515,71	7.384.112,87	19.486.438,91	0,90%	2,43%	0,55%	2,62%	92,73%	0,20%
Abril	823.950.515,71	25.851.787,40	32.136.890,74	820.486.671,05	2.821.258,68	22.307.697,59	0,34%	2,78%	0,81%	3,45%	80,58%	0,45%
Mai	820.486.671,05	35.646.585,65	29.852.747,85	832.559.595,75	6.279.086,90	28.586.784,49	0,76%	3,56%	0,87%	4,35%	81,86%	0,36%
Junho	832.559.595,75	40.094.045,21	39.081.010,69	837.584.999,56	4.012.369,29	32.599.153,78	0,48%	4,06%	0,60%	4,98%	81,59%	0,46%
Julho	837.584.999,56	38.902.405,59	36.790.464,35	848.059.585,66	8.362.644,86	40.961.798,64	1,00%	5,10%	0,83%	5,85%	87,17%	0,41%
Agosto	848.059.585,66	86.952.802,16	85.263.469,18	856.849.322,43	7.100.403,79	48.062.202,43	0,84%	5,98%	0,41%	6,28%	95,16%	0,52%
Setembro	856.849.322,43	103.877.612,56	133.233.766,17	833.036.710,66	5.543.541,84	53.605.744,27	0,65%	6,66%	0,85%	7,18%	92,74%	0,32%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

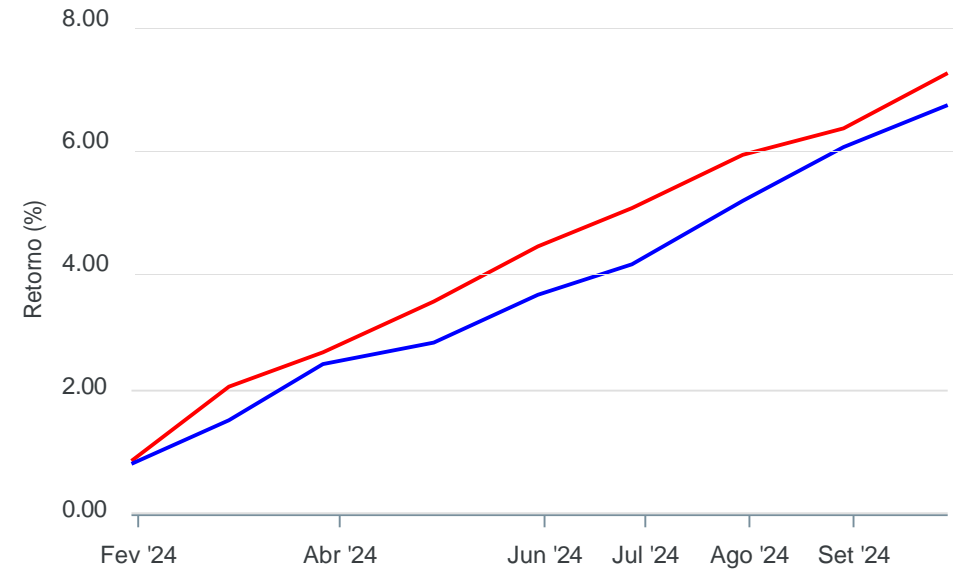


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMLL
- IDIV

BELÉMPREV



**PREFEITURA
MUNICIPAL
DE BELÉM**