

2024

Relatório Mensal

Julho

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 | 810.344,94 | 1,03% | 3.539.594.658,05 | 0,02% | 7º I b |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE... | 600.000,00 | 0,76% | 974.935.160,23 | 0,06% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 5.347.531,42 | 6,79% | 4.733.163.653,12 | 0,11% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 10.072.314,22 | 12,79% | 7.242.310.243,82 | 0,14% | 7º I b |
| ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA | 1.103.178,75 | 1,40% | 232.367.073,88 | 0,47% | 7º I b |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 4.316.655,05 | 5,48% | 1.916.003.713,61 | 0,23% | 7º I b |
| SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP | 1.161.095,62 | 1,47% | 113.243.042,37 | 1,03% | 7º I b |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 262.191,47 | 0,33% | 3.802.123.463,62 | 0,01% | 7º III a |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 13.692.627,19 | 17,38% | 12.128.254.135,40 | 0,11% | 7º III a |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 12.448.114,53 | 15,80% | 263.784.752,92 | 4,72% | 7º III a |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1.000.000,00 | 1,27% | 3.055.735.513,04 | 0,03% | 7º III a |
| LF BRADESCO 05/02/2027 IPCA + 5,71% | 2.631.018,04 | 3,34% | 0,00 | | 7º IV |
| LF BRADESCO 20/10/2025 IPCA + 6,22% | 2.717.856,52 | 3,45% | 0,00 | | 7º IV |
| LF BRADESCO 21/07/2025 IPCA + 5,68% | 1.103.822,79 | 1,40% | 0,00 | | 7º IV |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1 | 81.867,33 | 0,10% | 29.166.363,05 | 0,28% | 7º V a |
| INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 1.014.000,25 | 1,29% | 1.724.870.126,00 | 0,06% | 7º V b |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES | 125.119,46 | 0,16% | 240.896.790,05 | 0,05% | 8º I |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES | 1.886.922,54 | 2,40% | 766.690.040,42 | 0,25% | 8º I |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | 1.012.793,54 | 1,29% | 1.412.483.861,27 | 0,07% | 8º I |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 1.007.104,01 | 1,28% | 465.788.320,06 | 0,22% | 8º I |
| MAG BRASIL FI AÇÕES | 8.292.906,45 | 10,53% | 291.695.527,18 | 2,84% | 8º I |
| PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES | 375.652,44 | 0,48% | 176.724.703,17 | 0,21% | 8º I |
| PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES | 983.789,07 | 1,25% | 411.708.046,49 | 0,24% | 8º I |
| QLZ MOS FI AÇÕES | 2.724.881,96 | 3,46% | 97.008.776,54 | 2,81% | 8º I |
| SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES | 1.705.627,35 | 2,17% | 37.166.008,99 | 4,59% | 8º I |
| LSH FIP MULTIESTRATÉGIA | 509.820,81 | 0,65% | 107.386.992,69 | 0,47% | 10º II |
| HAZ FII - ATCR11 | 1.539.050,53 | 1,95% | 0,00 | | 11º |

Investimentos

\$ 78.777.702,15

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 78.777.702,15

Governança (Pró Gestão)

📊 NIVEL 1 14/06/2026

| Ativo | Saldo Atual | % Carteira | PL R\$ | % PL | Lei |
|-----------------------------------------------|-------------|------------|--------|------|-----|
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 | 251.415,87 | 0,32% | 0,00 | | 11º |

Investimentos

\$ 78.777.702,15


Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 78.777.702,15

Governança (Pró Gestão)

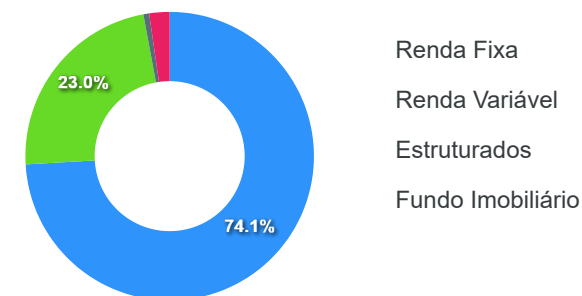
 NIVEL 1 14/06/2026

| Artigos | Limite (%) | Utilizado | Livre |
|--------------------------------------------------|------------|-------------------------|-------------------------|
| 7° I b - FI 100% Títulos TN | 100,00% | 29,72% 23.411.120,00 | 70,28% 55.366.582,15 |
| 7° III a - FI Referenciados RF | 65,00% | 34,79% 27.402.933,19 | 30,21% 23.802.573,21 |
| 7° IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de... | 20,00% | 8,19% 6.452.697,35 | 11,81% 9.302.843,08 |
| 7° V a - FIDC Cota Sênior | 5,00% | 0,10% 81.867,33 | 4,90% 3.857.017,78 |
| 7° V b - Fundos de RF - Crédito Privado | 5,00% | 1,29% 1.014.000,25 | 3,71% 2.924.884,86 |
| 8° I - Fundos de Ações | 35,00% | 22,99% 18.114.796,82 | 12,01% 9.457.398,93 |
| 10° II - Fundos em Participações (FIP) | 5,00% | 0,65% 509.820,81 | 4,35% 3.429.064,30 |
| 11° - Fundos Imobiliários | 5,00% | 2,27% 1.790.466,40 | 2,73% 2.148.418,71 |

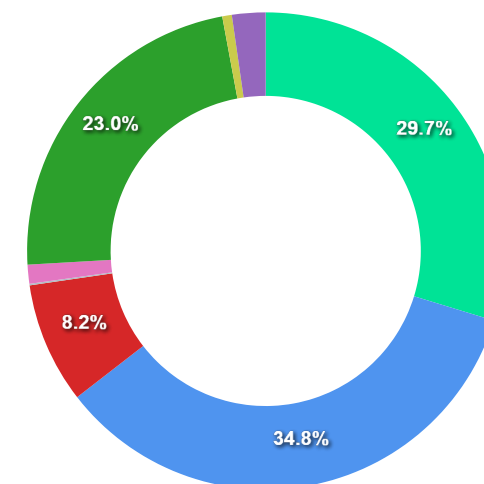
Governança (Pró Gestão)

NIVEL 1 14/06/2026

Segmentos



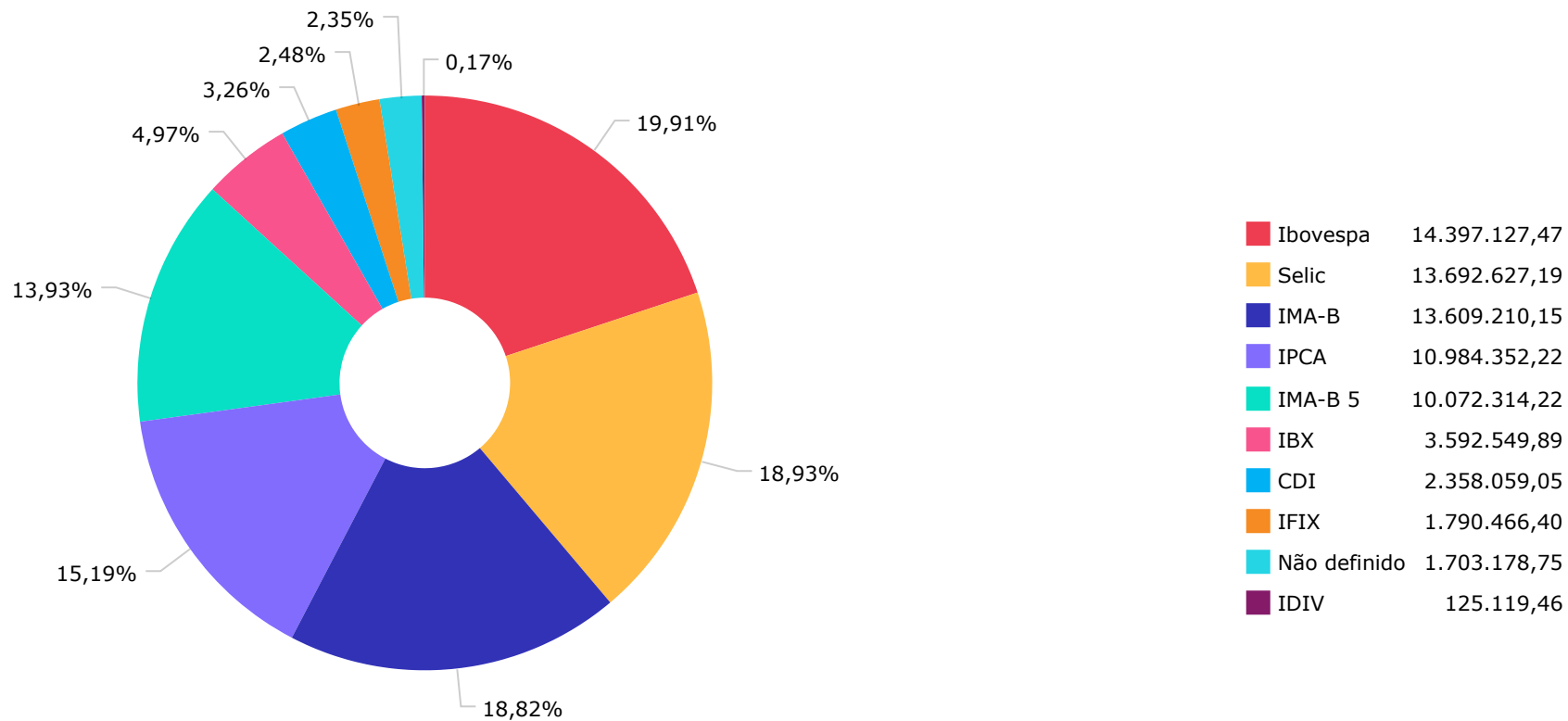
Artigos

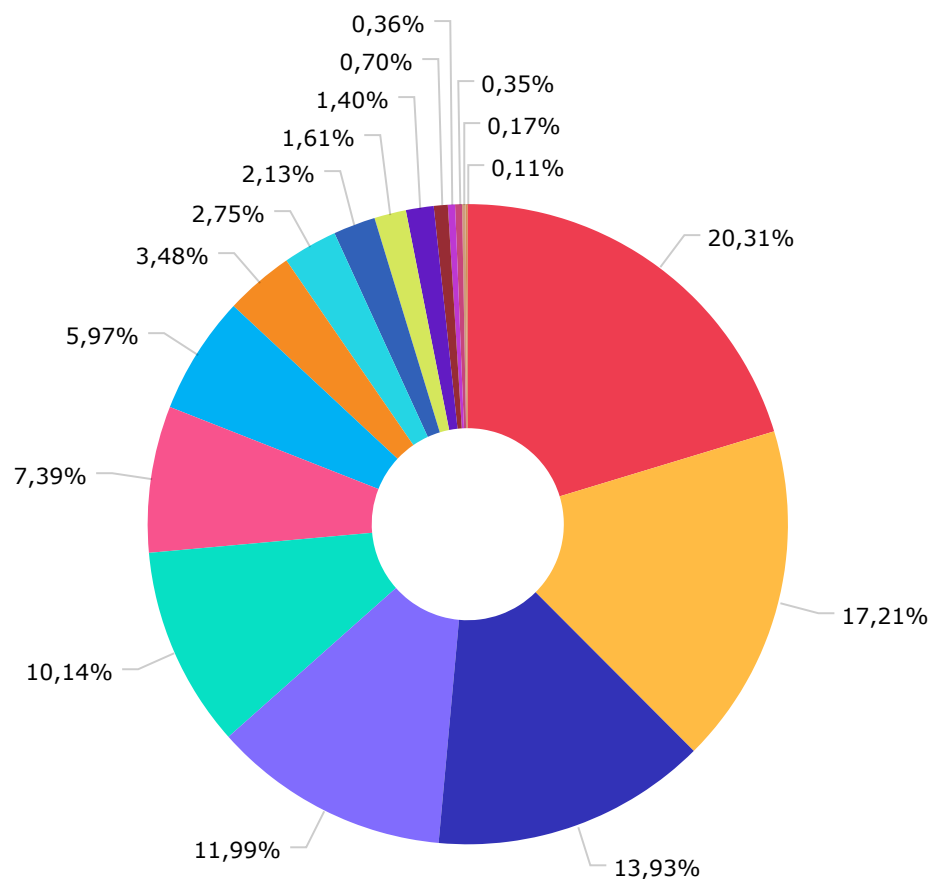


| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior | Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|---------------|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|---------------|
| 7° I a - Títulos TN SELIC | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 100,00% | 78.777.702,15 | 8° I - Fundos de Ações | 22,99% | 0,00% | 20,00% | 35,00% | 9.457.398,93 |
| 7° I b - FI 100% Títulos TN | 29,72% | 0,00% | 30,00% | 100,00% | 55.366.582,15 | 8° II - ETF de Ações | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 35,00% | 27.572.195,75 |
| 7° I c - ETF 100% Títulos TN | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 100,00% | 78.777.702,15 | 9° I - Renda Fixa - Dívida Ext... | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 7.877.770,22 |
| 7° II - Operações Compromissad... | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 3.938.885,11 | 9° II - Constituídos no Brasil | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 7.877.770,22 |
| 7° III a - FI Referenciados RF | 34,79% | 0,00% | 36,00% | 65,00% | 23.802.573,21 | 9° III - Ações - BDR Nível I | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 10,00% | 7.877.770,22 |
| 7° III b - FI de Índices Refer... | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 65,00% | 51.205.506,40 | 10° I - Fundos Multimercados | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 10,00% | 7.877.770,22 |
| 7° IV - Ativos Financeiros de ... | 8,19% | 0,00% | 3,00% | 20,00% | 9.302.843,08 | 10° II - Fundos em Participaçõ... | 0,65% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 3.429.064,30 |
| 7° V a - FIDC Cota Sênior | 0,10% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 3.857.017,78 | 10° III - Fundos de Ações - Me... | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 3.938.885,11 |
| 7° V b - Fundos de RF - Crédit... | 1,29% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 2.924.884,86 | 11° - Fundos Imobiliários | 2,27% | 0,00% | 3,00% | 5,00% | 2.148.418,71 |
| 7° V c - Fundos de Debentures ... | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 3.938.885,11 | 12° - Empréstimos Consignados | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 3.938.885,11 |

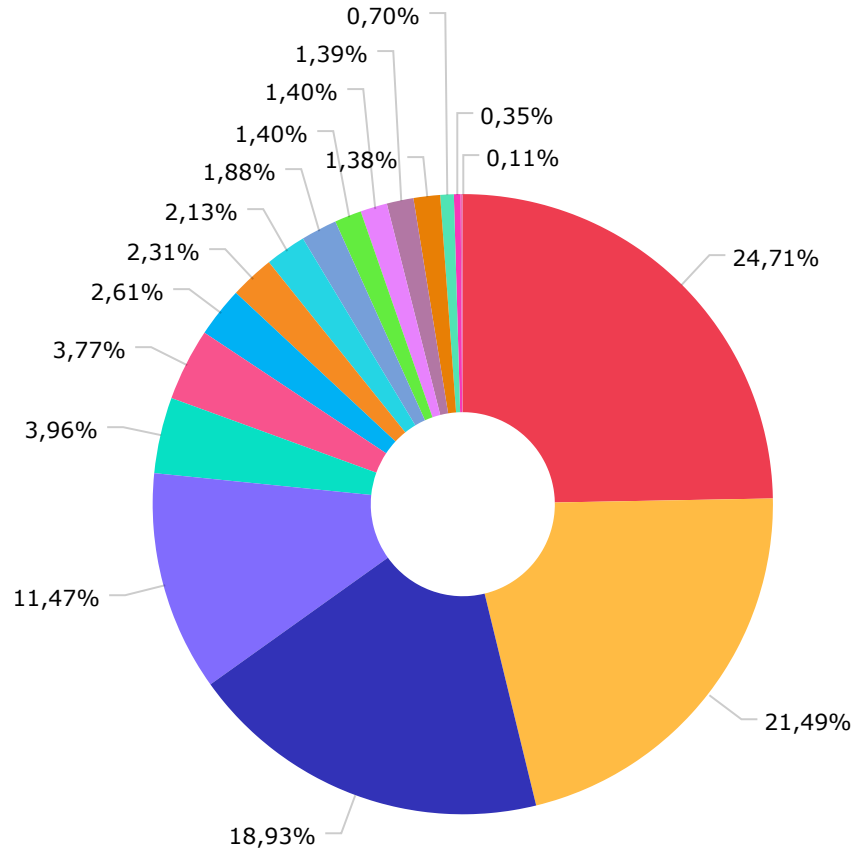
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|--------------------------------------------------------------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|--------------------|
| NÃO DEFINIDO - BENCHMARK | | | | | | | | |
| ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA | 0,98 | 3,70 | 3,06 | 2,56 | 4,96 | | 0,25 | 0,54 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI... | 0,70 | | | | | | 0,99 | 2,09 |
| CDI - BENCHMARK | | | | | | | | |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,94 | 6,47 | 2,61 | 5,37 | 12,17 | 27,54 | 0,01 | 0,03 |
| INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 0,95 | 6,43 | 2,64 | 5,36 | 12,05 | 27,76 | 0,04 | 0,08 |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 0,82 | 5,56 | 2,29 | 4,64 | 10,41 | 24,18 | 0,00 | 0,00 |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1 | -0,49 | -1,17 | -1,27 | -0,42 | -7,60 | -6,92 | 0,06 | 0,12 |
| IBOVESPA - BENCHMARK | | | | | | | | |
| PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES | 3,03 | -5,95 | 2,73 | -3,10 | 4,20 | 23,98 | 4,66 | 9,81 |
| PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES | 3,97 | -4,29 | 4,21 | -0,75 | 3,78 | 16,68 | 5,42 | 11,41 |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 1,35 | -5,43 | 0,67 | -0,04 | 3,56 | 25,60 | 5,76 | 12,14 |
| MAG BRASIL FI AÇÕES | 3,09 | -5,70 | 1,11 | -1,17 | 2,08 | 12,65 | 4,49 | 9,47 |
| QLZ MOS FI AÇÕES | 6,36 | -4,85 | 4,56 | -1,31 | -0,35 | 36,63 | 6,57 | 13,84 |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | 3,43 | -6,65 | 0,60 | -3,34 | -1,61 | 11,58 | 5,76 | 12,12 |
| IBX - BENCHMARK | | | | | | | | |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES | 3,85 | -2,04 | 1,90 | 1,20 | 3,24 | 17,51 | 6,28 | 13,23 |
| SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES | 5,90 | -5,55 | 0,17 | 3,15 | -9,29 | 2,74 | 7,07 | 14,89 |
| IDIV - BENCHMARK | | | | | | | | |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES | 1,74 | -2,18 | 2,55 | 1,40 | 9,81 | 28,57 | 4,92 | 10,35 |
| IMA-B - BENCHMARK | | | | | | | | |
| SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP | 1,99 | 0,10 | 2,06 | 0,39 | 3,08 | 16,89 | 1,93 | 4,07 |

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---------------------------------------------------------------|-------------|-------------|--------------|-------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 1,99 | -0,47 | 2,20 | 0,08 | 2,23 | 17,23 | 2,10 | 4,43 |
| IMA-B 5 - BENCHMARK | 0,91 | 4,27 | 2,37 | 3,56 | 8,16 | 20,37 | | |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,89 | 4,13 | 2,31 | 3,45 | 7,93 | 20,02 | 0,84 | 1,76 |
| IPCA - BENCHMARK | 0,38 | 2,87 | 1,05 | 2,44 | 4,50 | 8,67 | | |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,98 | 6,82 | 3,07 | 5,64 | 11,37 | | 0,25 | 0,54 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 0,96 | 3,35 | 1,85 | 2,67 | 7,47 | 23,28 | 0,64 | 1,35 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,88 | 2,80 | 1,43 | 2,32 | 7,03 | 21,01 | 0,56 | 1,18 |
| LSH FIP MULTIESTRATÉGIA | -0,06 | -0,45 | -0,20 | -0,38 | -0,75 | -1,50 | | |
| SELIC - BENCHMARK | 0,91 | 6,18 | 2,55 | 5,16 | 11,51 | 26,66 | | |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1,00 | 6,74 | 2,74 | 5,59 | 12,51 | 28,26 | 0,05 | 0,11 |
| IFIX - BENCHMARK | 0,52 | 1,61 | -0,50 | 0,94 | 5,24 | 19,57 | | |
| HAZ FII - ATCR11 | | | | | | | | |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 | | | | | | | | |

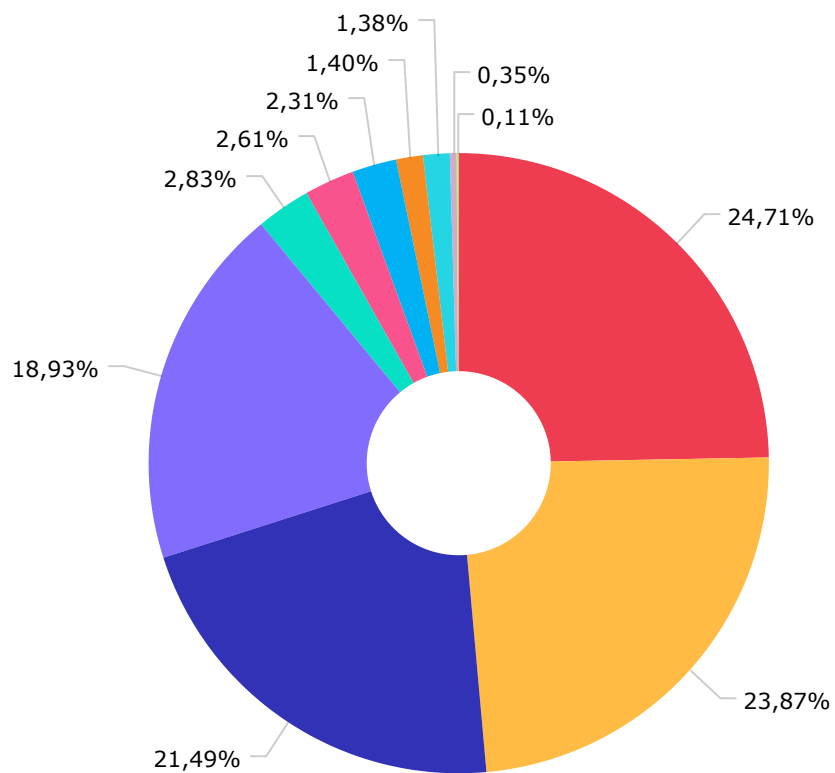




| | |
|-----------------------------------------------|---------------|
| Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento | 14.692.627,19 |
| Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento | 12.448.114,53 |
| Renda Fixa Indexados | 10.072.314,22 |
| Ações Índice Ativo | 8.668.558,89 |
| Ações Livre | 7.330.225,39 |
| Renda Fixa Duração Livre Soberano | 5.347.531,42 |
| Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre | 4.316.655,05 |
| Não classificado | 2.513.523,69 |
| Ações Valor/Crescimento | 1.990.893,08 |
| FII Desenvolvimento para Venda Gestão Ativa | 1.539.050,53 |
| Renda Fixa Duração Alta Soberano | 1.161.095,62 |
| Renda Fixa Duração Média Grau de Investimento | 1.014.000,25 |
| Fundos de Participações | 509.820,81 |
| Renda Fixa Simples | 262.191,47 |
| FII Renda Gestão Ativa | 251.415,87 |
| Ações Dividendos | 125.119,46 |
| FIDC Outros | 81.867,33 |



| | |
|-----------------------------------|---------------|
| ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT... | 17.867.948,33 |
| CAIXA DTVM | 15.544.965,10 |
| BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME... | 13.692.627,19 |
| MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS L... | 8.292.906,45 |
| SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GEST... | 2.866.722,97 |
| MOS GESTÃO DE INVESTIMENTOS LT... | 2.724.881,96 |
| CLARITAS ADMINISTRAÇÃO DE RECU... | 1.886.922,54 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 1.672.536,41 |
| GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA. | 1.539.050,53 |
| PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE... | 1.359.441,51 |
| INTER ASSET GESTAO DE RECURSOS... | 1.014.000,25 |
| CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA. | 1.012.793,54 |
| FINACAP INVESTIMENTOS LTDA | 1.007.104,01 |
| SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC... | 1.000.000,00 |
| RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL... | 509.820,81 |
| QLZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCE... | 251.415,87 |
| PETRA CAPITAL GESTÃO DE INVEST... | 81.867,33 |



| | |
|-----------------------------------|---------------|
| ITAU UNIBANCO S.A. | 17.867.948,33 |
| BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E... | 17.263.850,44 |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 15.544.965,10 |
| BANCO BRADESCO S.A. | 13.692.627,19 |
| RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL... | 2.048.871,34 |
| S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA... | 1.886.922,54 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 1.672.536,41 |
| INTER DISTRIBUIDORA DE TITULOS... | 1.014.000,25 |
| SANTANDER DISTRIBUIDORA DE TIT... | 1.000.000,00 |
| PLANNER CORRETORA DE VALORES S... | 251.415,87 |
| FINAXIS CORRETORA DE TÍTULOS E... | 81.867,33 |

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|--------------|--------------|---------------|--------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro | 73.693.056,65 | 1.567.328,09 | 336.192,17 | 74.347.798,04 | -576.394,53 | -576.394,53 | -0,77% ▼ | -0,77% | 0,99% | 0,99% | -77,78% | 1,88% |
| Fevereiro | 74.347.798,04 | 9.714.100,84 | 9.372.935,70 | 75.232.210,93 | 543.247,75 | -33.146,78 | 0,73% ▲ | -0,05% | 1,17% | 2,17% | -2,30% | 2,03% |
| Março | 75.232.210,93 | 2.165.125,60 | 1.313.433,91 | 76.522.901,62 | 438.999,00 | 405.852,22 | 0,58% ▲ | 0,53% | 0,57% | 2,74% | 19,34% | 1,64% |
| Abril | 76.522.901,62 | 932.052,61 | 391.823,98 | 76.132.754,50 | -930.375,75 | -524.523,53 | -1,21% ▼ | -0,68% | 0,78% | 3,55% | -19,15% | 2,20% |
| Mai | 76.132.754,50 | 873.747,40 | 890.515,07 | 76.143.737,47 | 27.750,64 | -496.772,89 | 0,04% ▲ | -0,65% | 0,86% | 4,44% | -14,64% | 1,82% |
| Junho | 76.143.737,47 | 2.277.838,85 | 2.520.166,24 | 76.070.220,92 | 168.810,84 | -327.962,05 | 0,22% ▲ | -0,43% | 0,63% | 5,09% | -8,45% | 2,26% |
| Julho | 76.070.220,92 | 2.882.870,92 | 1.510.847,83 | 78.777.702,15 | 1.335.458,14 | 1.007.496,09 | 1,72% ▲ | 1,29% | 0,69% | 5,82% | 22,16% | 1,81% |

Retorno Acumulado (Períodos)

| Período | Retorno \$ | Retorno % | Meta % |
|---------|-------------|-----------|--------|
| 1º Trim | 405.852,22 | 0,53% | 2,74% |
| 2º Trim | -733.814,27 | -0,95% | 2,28% |
| 1º Sem | -327.962,05 | -0,43% | 5,09% |

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

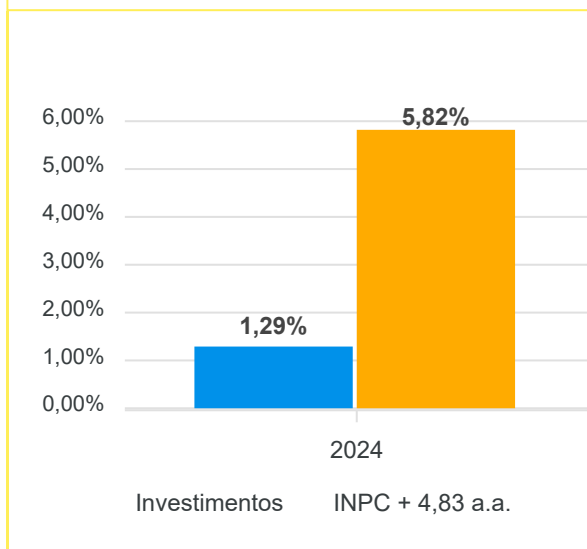
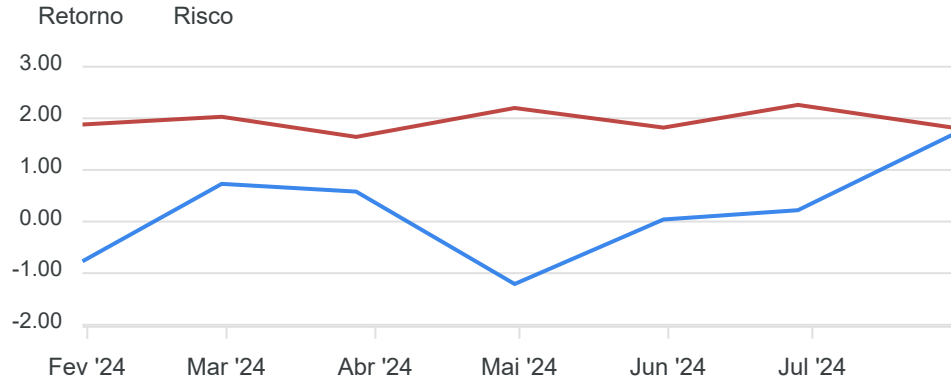
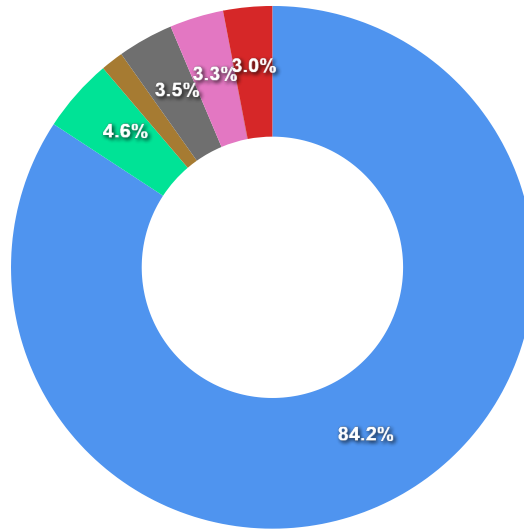


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 31/07/2024

| Disponibilidade | Valor | % |
|-----------------|---------------|-------|
| Até D+30 | 66.350.300,37 | 84,22 |
| Até D+180 | 3.592.549,89 | 4,56 |
| Até D+360 | 1.103.822,79 | 1,40 |
| Até D+720 | 2.717.856,52 | 3,45 |
| Até D+1800 | 2.631.018,04 | 3,34 |
| Até D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Acima D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Indeterminado | 2.382.154,54 | 3,02 |



| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---------------------------------------------------------------------------------|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|-------------------|--------------|--------------|
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 477.789,29 | 1.282.870,92 | 1.504.454,68 | 262.191,47 | 5.985,94 | 0,34% ▲ | 0,00% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 802.445,85 | 0,00 | 0,00 | 810.344,94 | 7.899,09 | 0,98% ▲ | 0,25% |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 13.557.664,29 | 0,00 | 0,00 | 13.692.627,19 | 134.962,90 | 1,00% ▲ | 0,05% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 5.296.469,74 | 0,00 | 0,00 | 5.347.531,42 | 51.061,68 | 0,96% ▲ | 0,64% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 9.983.180,83 | 0,00 | 0,00 | 10.072.314,22 | 89.133,39 | 0,89% ▲ | 0,84% |
| INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 1.004.493,73 | 0,00 | 0,00 | 1.014.000,25 | 9.506,52 | 0,95% ▲ | 0,04% |
| ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA | 1.092.500,80 | 0,00 | 0,00 | 1.103.178,75 | 10.677,95 | 0,98% ▲ | 0,25% |
| ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 12.204.935,43 | 0,00 | 0,00 | 12.448.114,53 | 243.179,10 | 1,99% ▲ | 2,10% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 4.279.102,98 | 0,00 | 0,00 | 4.316.655,05 | 37.552,07 | 0,88% ▲ | 0,56% |
| LF BRADESCO 05/02/2027 IPCA + 5,71% | 2.610.317,67 | 0,00 | 0,00 | 2.631.018,04 | 20.700,37 | 0,79% ▲ | - |
| LF BRADESCO 20/10/2025 IPCA + 6,22% | 2.696.289,51 | 0,00 | 0,00 | 2.717.856,52 | 21.567,01 | 0,80% ▲ | - |
| LF BRADESCO 21/07/2025 IPCA + 5,68% | 1.095.580,29 | 0,00 | 0,00 | 1.103.822,79 | 8.242,50 | 0,75% ▲ | - |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1 | 82.266,94 | 0,00 | 0,00 | 81.867,33 | -399,61 | -0,49% ▼ | 0,06% |
| SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP | 1.138.492,21 | 0,00 | 0,00 | 1.161.095,62 | 22.603,41 | 1,99% ▲ | 1,93% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO... | 0,00 | 600.000,00 | 0,00 | 600.000,00 | 0,00 | 0,00% | 0,99% |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,00 | 1.000.000,00 | 0,00 | 1.000.000,00 | 0,00 | 0,00% | 0,01% |
| | 56.321.529,56 | 2.882.870,92 | 1.504.454,68 | 58.362.618,12 | 662.672,32 | 1,15% | 0,76% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---------------------------------|----------------|------------|----------|---------------|------------|-----------|-------------|
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES | 122.978,31 | 0,00 | 0,00 | 125.119,46 | 2.141,15 | 1,74% ▲ | 4,92% |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES | 1.817.056,35 | 0,00 | 0,00 | 1.886.922,54 | 69.866,19 | 3,85% ▲ | 6,28% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | 979.198,57 | 0,00 | 0,00 | 1.012.793,54 | 33.594,97 | 3,43% ▲ | 5,76% |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 993.704,36 | 0,00 | 0,00 | 1.007.104,01 | 13.399,65 | 1,35% ▲ | 5,76% |
| MAG BRASIL FI AÇÕES | 8.044.515,38 | 0,00 | 0,00 | 8.292.906,45 | 248.391,07 | 3,09% ▲ | 4,49% |
| PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES | 361.312,78 | 0,00 | 0,00 | 375.652,44 | 14.339,66 | 3,97% ▲ | 5,42% |
| PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES | 954.822,44 | 0,00 | 0,00 | 983.789,07 | 28.966,63 | 3,03% ▲ | 4,66% |
| QLZ MOS FI AÇÕES | 2.562.059,62 | 0,00 | 0,00 | 2.724.881,96 | 162.822,34 | 6,36% ▲ | 6,57% |
| SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES | 1.610.670,28 | 0,00 | 0,00 | 1.705.627,35 | 94.957,07 | 5,90% ▲ | 7,07% |
| - | 17.446.318,09 | 0,00 | 0,00 | 18.114.796,82 | 668.478,73 | 3,83% | 5,41% |

| ESTRUTURADOS | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|-------------------------|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|-------------|
| LSH FIP MULTIESTRATÉGIA | 510.132,06 | 0,00 | 0,00 | 509.820,81 | -311,25 | -0,06% ▼ | - |
| - | 510.132,06 | 0,00 | 0,00 | 509.820,81 | -311,25 | -0,06% | 0,00% |

| FUNDOS IMOBILIÁRIOS | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|-----------------------------------------------|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| HAZ FII - ATCR11 | 1.543.379,58 | 0,00 | 6.393,15 | 1.539.050,53 | 2.064,10 | 0,13% ▲ | - |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 | 248.861,63 | 0,00 | 0,00 | 251.415,87 | 2.554,24 | 1,03% ▲ | - |
| - | 1.792.241,21 | 0,00 | 6.393,15 | 1.790.466,40 | 4.618,34 | 0,26% | 0,00% |

Cenário Econômico

O mês de julho trouxe alívio para a maioria das carteiras de investimentos dos nossos clientes. Os ativos de renda fixa fecharam no positivo, especialmente aqueles ligados à inflação. Esses investimentos foram beneficiados pelo fechamento da curva de juros. No campo da renda variável, os ativos atrelados ao IBOVESPA, também apresentaram desempenho positivo. Esse movimento fez com que a maioria dos fundos de ações registrassem resultados favoráveis, reduzindo os resultados amargos dos dois últimos meses. É importante destacar que o segmento exterior exige cautela, especialmente em relação ao início do processo de corte de juros.

Os gestores de carteiras viram seus esforços sendo recompensados em julho, tanto na renda fixa quanto na renda variável. A diversificação e o acompanhamento constante do mercado continuam sendo estratégias importantes para obtenção de bons resultados.

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 do DRPPS, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

Como já dissemos, os ativos de renda fixa performaram de forma bastante competitiva, especialmente aqueles ligados à inflação. Esses investimentos foram beneficiados pelo fechamento da curva de juros. No campo da renda variável, os ativos atrelados ao IBOVESPA, também apresentaram desempenho positivo. Esse movimento fez com que a maioria dos fundos de ações registrassem resultados favoráveis. A renda fixa segue como referência de rentabilidade, com o CDI se destacando na relação risco x retorno.

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 agosto de 2024.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **PREVIGUABA IGUABA GRANDE - RJ** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Julho/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 **PREVIGUABA IGUABA GRANDE - RJ** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Julho/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 **PREVIGUABA IGUABA GRANDE - RJ** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

