

2024

Relatório Mensal e 3º trimestre de 2024

Setembro

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 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	589.112,05	0,73%	3.640.087.521,46	0,02%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	1.197.715,31	1,49%	879.894.751,76	0,14%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.411.961,08	6,73%	4.436.237.468,68	0,12%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.169.483,89	12,64%	6.913.810.528,18	0,15%	7º I b
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	1.079.316,86	1,34%	179.742.463,76	0,60%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.374.601,16	5,44%	1.856.541.125,92	0,24%	7º I b
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1.157.938,37	1,44%	101.270.826,48	1,14%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	385.478,84	0,48%	3.861.447.255,05	0,01%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	13.940.151,49	17,33%	14.753.446.791,76	0,09%	7º III a
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	12.411.001,84	15,43%	171.427.308,96	7,24%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.017.937,52	1,27%	3.331.476.040,52	0,03%	7º III a
LF BRADESCO 05/02/2027 IPCA + 5,71%	2.666.619,07	3,32%	0,00		7º IV
LF BRADESCO 20/10/2025 IPCA + 6,22%	2.756.964,13	3,43%	0,00		7º IV
LF BRADESCO 21/07/2025 IPCA + 5,68%	1.118.676,60	1,39%	0,00		7º IV
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	81.211,36	0,10%	28.932.663,18	0,28%	7º V a
INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.031.750,43	1,28%	1.716.250.305,55	0,06%	7º V b
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	132.142,87	0,16%	253.323.501,90	0,05%	8º I
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	1.891.894,84	2,35%	790.163.486,96	0,24%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.040.428,96	1,29%	1.370.744.573,46	0,08%	8º I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.070.919,64	1,33%	490.448.090,25	0,22%	8º I
MAG BRASIL FI AÇÕES	8.516.507,05	10,59%	293.738.622,05	2,90%	8º I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	373.266,20	0,46%	172.057.049,30	0,22%	8º I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	981.904,31	1,22%	457.095.113,70	0,21%	8º I
QLZ MOS FI AÇÕES	2.756.829,31	3,43%	111.647.923,24	2,47%	8º I
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.592.977,46	1,98%	15.310.888,18	10,40%	8º I
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	395.620,40	0,49%	45.960.272,96	0,86%	9º III
LSH FIP MULTISTRATÉGIA	509.198,67	0,63%	107.255.945,79	0,47%	10º II

Investimentos

\$ 80.438.998,39

Disponibilidades Financeiras

\$ 2.801.240,31

Total Carteira


\$ 83.240.238,70

Governança (Pró Gestão)

📊 NIVEL 1 14/06/2026

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
HAZ FII - ATCR11	1.544.249,85	1,92%	0,00		11º
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	243.138,83	0,30%	0,00		11º


Investimentos

 80.438.998,39


Disponibilidades Financeiras

 2.801.240,31

Total Carteira

 83.240.238,70

Governança (Pró Gestão)

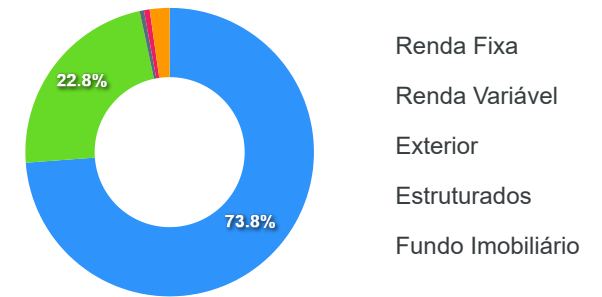
 NIVEL 1 14/06/2026

Artigos	Limite (%)	Utilizado		Livre	
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	29,81%	23.980.128,72	70,19%	56.458.869,67
7° III a - FI Referenciados RF	65,00%	34,50%	27.754.569,69	30,50%	24.530.779,26
7° IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	8,13%	6.542.259,80	11,87%	9.545.539,88
7° V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	0,10%	81.211,36	4,90%	3.940.738,56
7° V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	1,28%	1.031.750,43	3,72%	2.990.199,49
8° I - Fundos de Ações	35,00%	22,82%	18.356.870,64	12,18%	9.796.778,80
9° III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,49%	395.620,40	9,51%	7.648.279,44
10° II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	0,63%	509.198,67	4,37%	3.512.751,25
11° - Fundos Imobiliários	5,00%	2,22%	1.787.388,68	2,78%	2.234.561,24

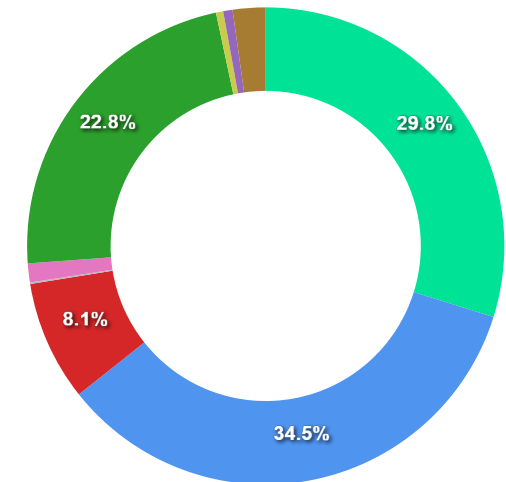
Governança (Pró Gestão)

🔗 NIVEL 1 14/06/2026

Segmentos



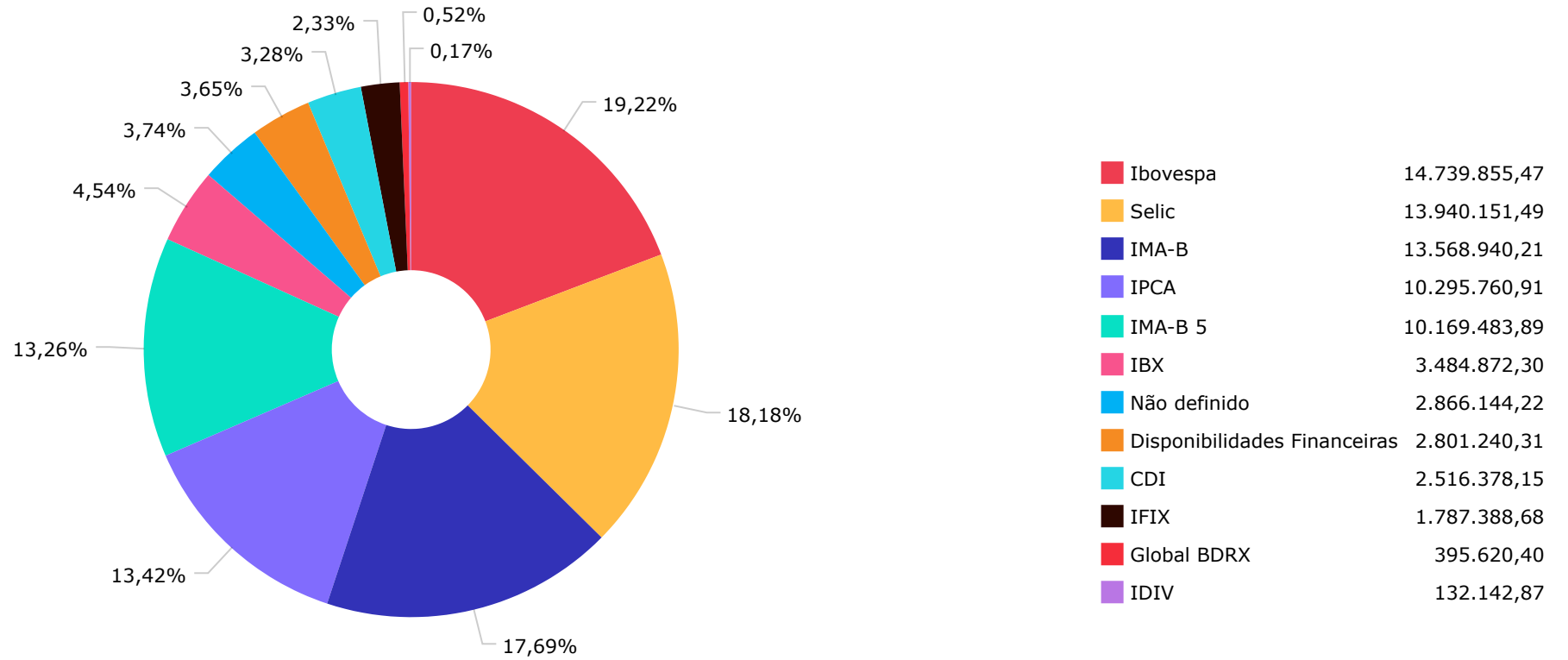
Artigos

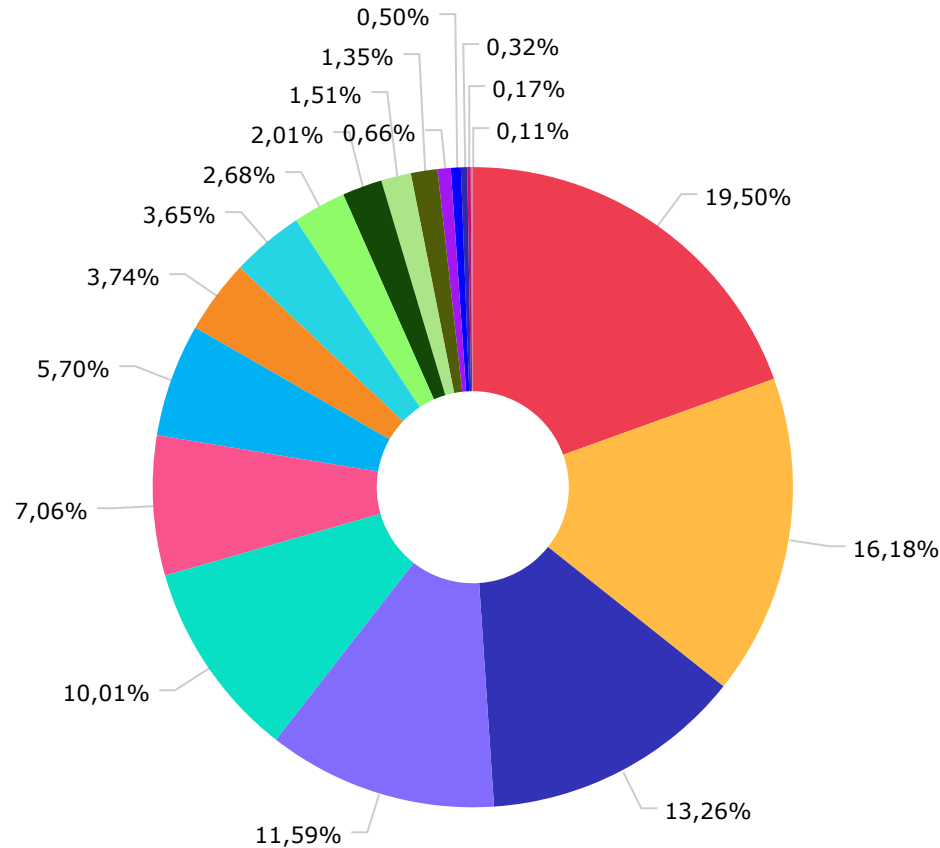


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	80.438.998,39	8° I - Fundos de Ações	22,82%	0,00%	20,00%	35,00%	9.796.778,80
7° I b - FI 100% Títulos TN	29,81%	0,00%	30,00%	100,00%	56.458.869,67	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	35,00%	28.153.649,44
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	80.438.998,39	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.043.899,84
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.021.949,92	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.043.899,84
7° III a - FI Referenciados RF	34,50%	0,00%	36,00%	65,00%	24.530.779,26	9° III - Ações - BDR Nível I	0,49%	0,00%	1,00%	10,00%	7.648.279,44
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	52.285.348,95	10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	8.043.899,84
7° IV - Ativos Financeiros de ...	8,13%	0,00%	3,00%	20,00%	9.545.539,88	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,63%	0,00%	1,00%	5,00%	3.512.751,25
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,10%	0,00%	1,00%	5,00%	3.940.738,56	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.021.949,92
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	1,28%	0,00%	1,00%	5,00%	2.990.199,49	11° - Fundos Imobiliários	2,22%	0,00%	3,00%	5,00%	2.234.561,24
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.021.949,92	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.021.949,92

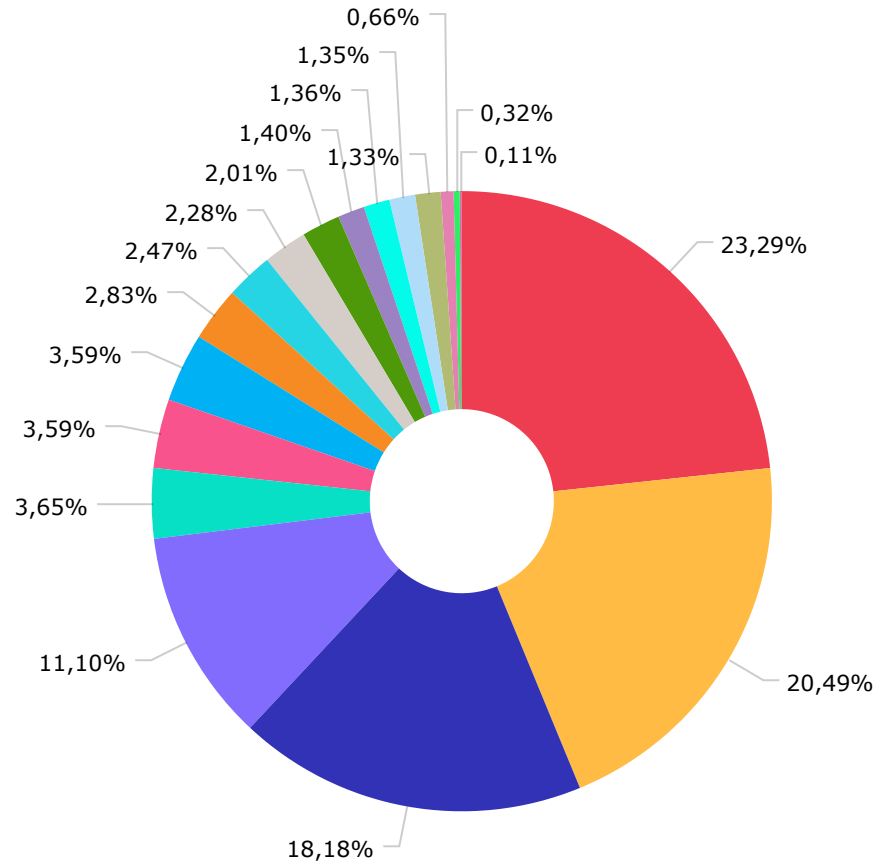
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	0,31	0,93	1,90	-0,81	1,23		1,13	2,37
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,30						1,12	2,35
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	0,50		1,81				0,80	1,69
CDI - BENCHMARK								
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88	8,38	2,75	5,44	11,55	26,85	0,03	0,06
INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,84	8,30	2,71	5,40	11,48	26,98	0,05	0,11
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,75	7,19	2,38	4,70	9,96	23,52	0,01	0,02
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,40	-1,96	-1,28	-0,55	-7,51	-6,60		
GLOBAL BDRX - BENCHMARK								
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,24	33,91	-1,76	12,92	41,98	56,16	6,45	13,59
IBOVESPA - BENCHMARK								
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-0,08	0,57	7,77	1,82	15,61	24,25	5,61	11,82
MAG BRASIL FI AÇÕES	-3,26	-3,16	5,87	1,23	10,13	7,86	5,53	11,64
QLZ MOS FI AÇÕES	-4,55	-3,73	7,60	-3,02	8,70	29,73	6,70	14,10
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	-4,69	-4,90	3,31	-1,79	7,76	6,83	5,41	11,39
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-2,45	-4,11	6,25	-2,52	7,33	8,42	4,72	9,95
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,87	-6,13	2,84	-2,02	6,45	16,68	5,16	10,87
IBX - BENCHMARK								
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	-4,18	-1,78	4,12	-1,56	9,19	9,73	6,09	12,83
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	-7,51	-11,78	-1,10	-10,01	-6,08	-11,01	9,84	20,73
IDIV - BENCHMARK								
	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40		

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,78	3,31	7,45	7,59	17,87	32,87	5,39	11,35
IMA-B - BENCHMARK	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28		
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-0,81	-0,17	1,71	-0,30	4,33	13,38	1,89	3,99
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,78	-0,77	1,69	-0,48	3,72	14,20	1,82	3,84
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,40	5,30	1,92	3,18	8,43	21,06		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38	5,14	1,87	3,07	8,21	20,61	0,96	2,03
IPCA - BENCHMARK	0,44	3,31	0,80	1,86	4,42	9,84		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,63	4,18	2,23	2,55	8,39	20,05	0,50	1,06
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,52	4,59	2,18	2,74	7,65	21,44	0,56	1,18
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,06	-0,57	-0,18	-0,38	-0,75	-1,51		
SELIC - BENCHMARK	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98		
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88	8,67	2,82	5,58	11,94	27,59	0,02	0,04
IFIX - BENCHMARK	-2,58	-0,16	-1,24	-3,00	2,69	10,54		
HAZ FII - ATR11								
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11								

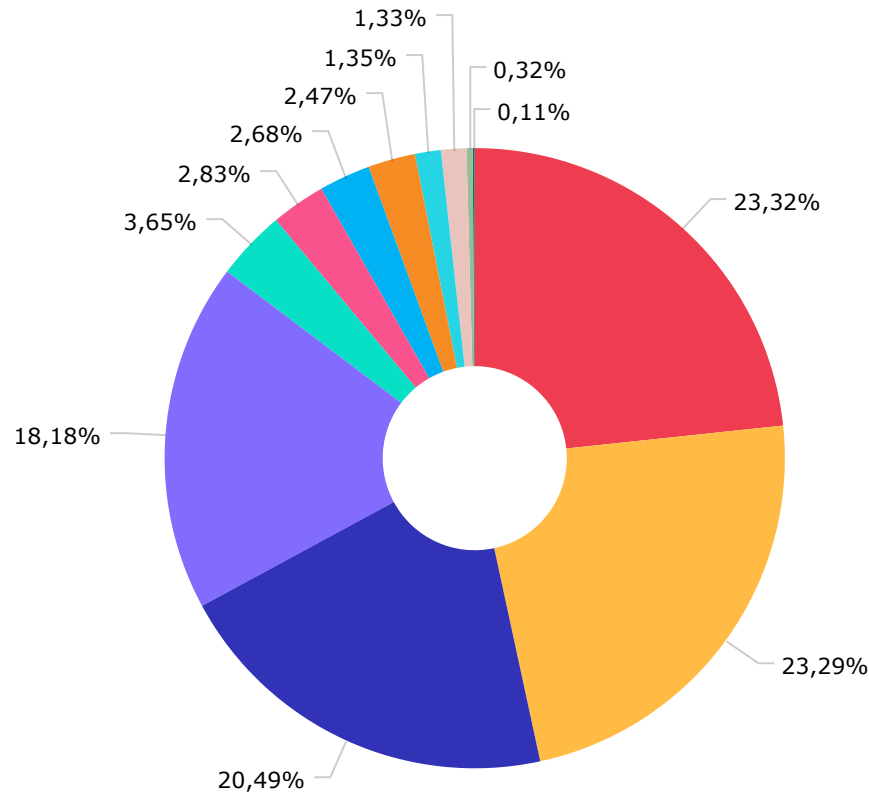




Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	14.958.089,01
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	12.411.001,84
Renda Fixa Indexados	10.169.483,89
Ações Índice Ativo	8.889.773,25
Ações Livre	7.677.750,97
Renda Fixa Duração Livre Soberano	5.411.961,08
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	4.374.601,16
Não classificado	2.866.144,22
Disponibilidades Financeiras	2.801.240,31
Ações Valor/Crescimento	2.052.823,95
FII Desenvolvimento para Venda Gestão Ativa	1.544.249,85
Renda Fixa Duração Alta Soberano	1.157.938,37
Renda Fixa Duração Média Grau de Investimento	1.031.750,43
Fundos de Participações	509.198,67
Renda Fixa Simples	385.478,84
FII Renda Gestão Ativa	243.138,83
Ações Dividendos	132.142,87
FIDC Outros	81.211,36



ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT...	17.864.919,86
CAIXA DTVM	15.713.587,84
BANCO BRADESCO S.A.	13.940.151,49
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS L...	8.516.507,05
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.801.240,31
MOS GESTÃO DE INVESTIMENTOS LT...	2.756.829,31
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GEST...	2.750.915,83
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	2.172.306,20
CLARITAS ADMINISTRAÇÃO DE RECU...	1.891.894,84
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	1.750.790,91
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.	1.544.249,85
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	1.070.919,64
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	1.040.428,96
INTER ASSET GESTAO DE RECURSOS...	1.031.750,43
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	1.017.937,52
RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL...	509.198,67
QLZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCE...	243.138,83
PETRA CAPITAL GESTÃO DE INVEST...	81.211,36



BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	17.886.391,70
ITAU UNIBANCO S.A.	17.864.919,86
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.713.587,84
BANCO BRADESCO S.A.	13.940.151,49
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.801.240,31
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	2.172.306,20
RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL...	2.053.448,52
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	1.891.894,84
INTER DISTRIBUIDORA DE TITULOS...	1.031.750,43
SANTANDER DISTRIBUIDORA DE TIT...	1.017.937,52
PLANNER CORRETORA DE VALORES S...	243.138,83
FINAXIS CORRETORA DE TÍTULOS E...	81.211,36

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%
Agosto	78.777.702,15	4.787.193,40	4.286.489,76	80.627.726,06	1.349.320,27	2.356.816,36	1,70% ▲	3,01%	0,27%	6,10%	49,34%	2,21%
Setembro	80.627.726,06	1.176.417,59	800.535,89	80.438.998,39	-564.609,37	1.792.206,99	-0,70% ▼	2,29%	0,88%	7,03%	32,57%	1,95%

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%
3º Trim	2.120.169,04	2,73%	1,85%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

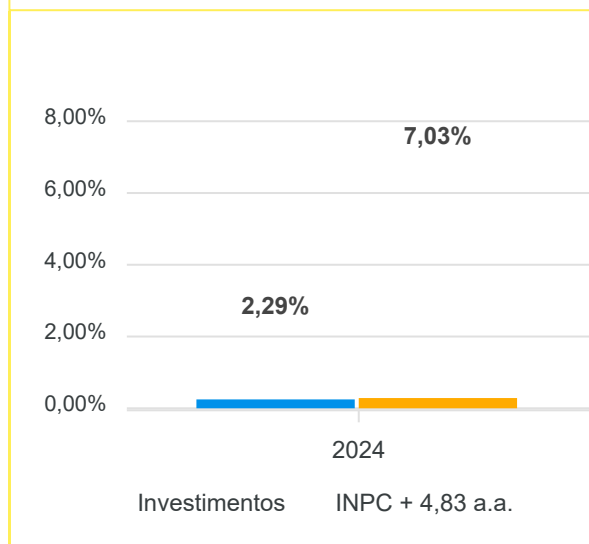
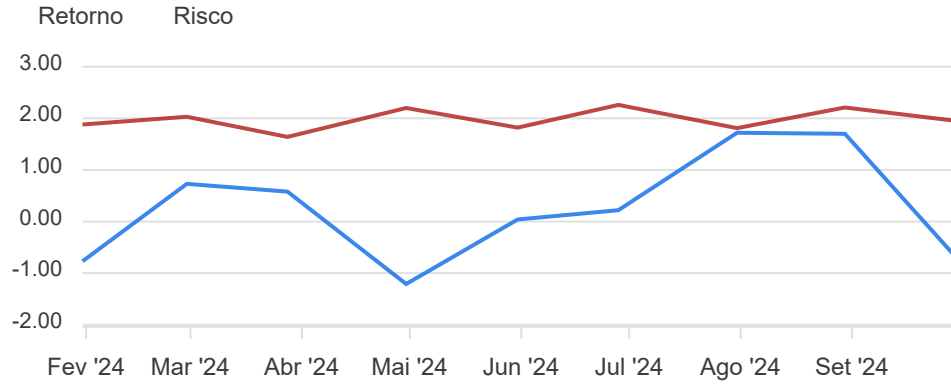
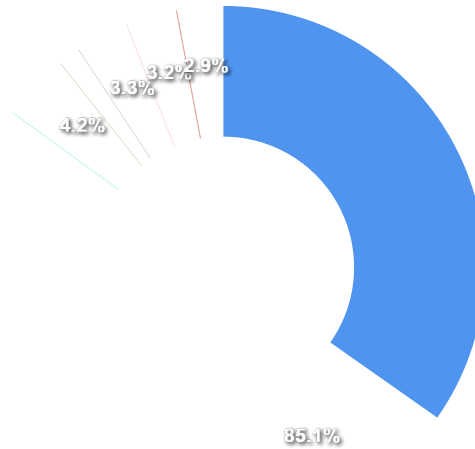


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 30/09/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	70.835.307,89	85,10
Até D+180	3.484.872,30	4,19
Até D+360	1.118.676,60	1,34
Até D+720	2.756.964,13	3,31
Até D+1800	2.666.619,07	3,20
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	2.377.798,71	2,86



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	6.653,90	1.176.417,59	800.535,89	385.478,84	2.943,24	0,25% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	586.199,78	0,00	0,00	589.112,05	2.912,27	0,50% ▲	0,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.194.151,47	0,00	0,00	1.197.715,31	3.563,84	0,30% ▲	1,12%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	13.817.863,52	0,00	0,00	13.940.151,49	122.287,97	0,88% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.383.720,74	0,00	0,00	5.411.961,08	28.240,34	0,52% ▲	0,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.130.797,04	0,00	0,00	10.169.483,89	38.686,85	0,38% ▲	0,96%
INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.023.106,53	0,00	0,00	1.031.750,43	8.643,90	0,84% ▲	0,05%
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	1.076.022,87	0,00	0,00	1.079.316,86	3.293,99	0,31% ▲	1,13%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	12.508.543,74	0,00	0,00	12.411.001,84	-97.541,90	-0,78% ▼	1,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.347.082,00	0,00	0,00	4.374.601,16	27.519,16	0,63% ▲	0,50%
LF BRADESCO 05/02/2027 IPCA + 5,71%	2.652.800,98	0,00	0,00	2.666.619,07	13.818,09	0,52% ▲	-
LF BRADESCO 20/10/2025 IPCA + 6,22%	2.739.664,41	0,00	0,00	2.756.964,13	17.299,72	0,63% ▲	-
LF BRADESCO 21/07/2025 IPCA + 5,68%	1.112.292,27	0,00	0,00	1.118.676,60	6.384,33	0,57% ▲	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	81.535,13	0,00	0,00	81.211,36	-323,77	-0,40% ▼	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.009.094,15	0,00	0,00	1.017.937,52	8.843,37	0,88% ▲	0,03%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1.167.348,76	0,00	0,00	1.157.938,37	-9.410,39	-0,81% ▼	1,89%
	58.836.877,29	1.176.417,59	800.535,89	59.389.920,00	177.161,01	0,30%	0,73%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	133.185,72	0,00	0,00	132.142,87	-1.042,85	-0,78% ▼	5,39%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	1.974.510,41	0,00	0,00	1.891.894,84	-82.615,57	-4,18% ▼	6,09%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.066.518,62	0,00	0,00	1.040.428,96	-26.089,66	-2,45% ▼	4,72%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.071.778,58	0,00	0,00	1.070.919,64	-858,94	-0,08% ▼	5,61%
MAG BRASIL FI AÇÕES	8.803.290,98	0,00	0,00	8.516.507,05	-286.783,93	-3,26% ▼	5,53%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	391.642,79	0,00	0,00	373.266,20	-18.376,59	-4,69% ▼	5,41%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.032.212,25	0,00	0,00	981.904,31	-50.307,94	-4,87% ▼	5,16%
QLZ MOS FI AÇÕES	2.888.157,16	0,00	0,00	2.756.829,31	-131.327,85	-4,55% ▼	6,70%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.722.276,22	0,00	0,00	1.592.977,46	-129.298,76	-7,51% ▼	9,84%
-	19.083.572,73	0,00	0,00	18.356.870,64	-726.702,09	-3,81%	6,07%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	509.509,74	0,00	0,00	509.198,67	-311,07	-0,06% ▼	-
-	509.509,74	0,00	0,00	509.198,67	-311,07	-0,06%	0,00%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
HAZ FII - ATCR11	1.541.226,50	0,00	0,00	1.544.249,85	3.023,35	0,20% ▲	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	247.685,31	0,00	0,00	243.138,83	-4.546,48	-1,84% ▼	-
-	1.788.911,81	0,00	0,00	1.787.388,68	-1.523,13	-0,09%	0,00%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	408.854,49	0,00	0,00	395.620,40	-13.234,09	-3,24% ▼	6,45%
	408.854,49	0,00	0,00	395.620,40	-13.234,09	-3,24%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	477.789,29	4.572.457,73	4.680.100,09	385.478,84	15.331,91	0,30% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	802.445,85	0,00	814.737,93	0,00	12.292,08	1,53% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	600.000,00	17.466,98	589.112,05	6.579,03	1,10% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.195.263,97	0,00	1.197.715,31	2.451,34	0,21% ▲
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	13.557.664,29	0,00	0,00	13.940.151,49	382.487,20	2,82% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.296.469,74	0,00	0,00	5.411.961,08	115.491,34	2,18% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.983.180,83	0,00	0,00	10.169.483,89	186.303,06	1,87% ▲
INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.004.493,73	0,00	0,00	1.031.750,43	27.256,70	2,71% ▲
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	1.092.500,80	0,00	1.079.175,33	0,00	-13.325,47	-1,22% ▼
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	0,00	1.078.760,21	0,00	1.079.316,86	556,65	0,05% ▲
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	12.204.935,43	0,00	0,00	12.411.001,84	206.066,41	1,69% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.279.102,98	0,00	0,00	4.374.601,16	95.498,18	2,23% ▲
LF BRADESCO 05/02/2027 IPCA + 5,71%	2.610.317,67	0,00	0,00	2.666.619,07	56.301,40	2,16% ▲
LF BRADESCO 20/10/2025 IPCA + 6,22%	2.696.289,51	0,00	0,00	2.756.964,13	60.674,62	2,25% ▲
LF BRADESCO 21/07/2025 IPCA + 5,68%	1.095.580,29	0,00	0,00	1.118.676,60	23.096,31	2,11% ▲
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	82.266,94	0,00	0,00	81.211,36	-1.055,58	-1,28% ▼
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	1.000.000,00	0,00	1.017.937,52	17.937,52	1,79% ▲
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1.138.492,21	0,00	0,00	1.157.938,37	19.446,16	1,71% ▲
	56.321.529,56	8.446.481,91	6.591.480,33	59.389.920,00	1.213.388,86	2,09%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	122.978,31	0,00	0,00	132.142,87	9.164,56	7,45% ▲
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	1.817.056,35	0,00	0,00	1.891.894,84	74.838,49	4,12% ▲
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	979.198,57	0,00	0,00	1.040.428,96	61.230,39	6,25% ▲
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	993.704,36	0,00	0,00	1.070.919,64	77.215,28	7,77% ▲
MAG BRASIL FI AÇÕES	8.044.515,38	0,00	0,00	8.516.507,05	471.991,67	5,87% ▲
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	361.312,78	0,00	0,00	373.266,20	11.953,42	3,31% ▲
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	954.822,44	0,00	0,00	981.904,31	27.081,87	2,84% ▲
QLZ MOS FI AÇÕES	2.562.059,62	0,00	0,00	2.756.829,31	194.769,69	7,60% ▲
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.610.670,28	0,00	0,00	1.592.977,46	-17.692,82	-1,10% ▼
	17.446.318,09	0,00	0,00	18.356.870,64	910.552,55	5,22%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	510.132,06	0,00	0,00	509.198,67	-933,39	-0,18% ▼
	510.132,06	0,00	0,00	509.198,67	-933,39	-0,18%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
HAZ FII - ATR11	1.543.379,58	0,00	6.393,15	1.544.249,85	7.263,42	0,47% ▲
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	248.861,63	0,00	0,00	243.138,83	-5.722,80	-2,30% ▼
	1.792.241,21	0,00	6.393,15	1.787.388,68	1.540,62	0,09%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	400.000,00	0,00	395.620,40	-4.379,60	-1,09% ▼
	0,00	400.000,00	0,00	395.620,40	-4.379,60	-1,09%

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.

Mantendo o bom humor de julho, agosto também apresentou um forte desempenho para as carteiras de nossos clientes. Os ativos de renda fixa, embora tenham tido um desempenho inferior ao de julho, ainda assim contribuíram positivamente para a carteira. Já os ativos de renda variável ligados ao IBOVESPA, tiveram um desempenho robusto, impulsionando significativamente os resultados. Por fim, os investimentos no exterior, apesar de terem passado boa parte do mês em território negativo, registraram uma recuperação na última semana, resultando em mais um segmento com desempenho positivo nas carteiras.

Depois dos dois meses anteriores do trimestre de desempenhos positivos, setembro foi marcado por muita volatilidade nos principais índices do mercado, refletindo no desempenho das carteiras de nossos clientes. A maioria dos índices fechou o mês no negativo, incluindo fundos de renda fixa atrelados à inflação. No mercado de renda variável e em ativos no exterior, a grande maioria terminou o mês com quedas acentuadas.

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 investimentos presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização, estão presentes na lista exaustiva de instituições com as quais os RPPS podem manter investimentos, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Distribuição por Gestoras e Administradoras

As gestoras e administradoras dos fundos de investimentos presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização, estão presentes na lista exaustiva de instituições com as quais os RPPS podem manter investimentos, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

Depois dos dois meses anteriores do trimestre de desempenhos positivos, setembro foi marcado por muita volatilidade nos principais índices do mercado, refletindo no desempenho da carteira. Como já dissemos, a maioria dos índices fechou o mês no negativo, incluindo fundos de renda fixa atrelados à inflação. No mercado de renda variável e em ativos no exterior, a grande maioria terminou o mês com quedas acentuadas. De qualquer forma, a renda fixa segue como referência de rentabilidade, com o CDI mantendo a melhor relação risco x retorno x liquidez.

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, 10 de outubro 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 **Setembro/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 **Setembro/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.

