

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 TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	594.355,00	0,75%	3.760.040.315,03	0,02%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	1.205.770,58	1,52%	916.546.894,83	0,13%	7º I b
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	1.086.493,89	1,37%	183.734.330,23	0,59%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.410.484,07	5,56%	1.757.846.296,75	0,25%	7º I b
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1.149.888,02	1,45%	96.551.168,47	1,19%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.936.658,91	2,44%	4.036.357.184,84	0,05%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.069.464,06	17,75%	15.416.999.740,59	0,09%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.627.442,63	14,67%	19.218.803.160,79	0,06%	7º III a
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	12.303.695,91	15,52%	149.489.215,21	8,23%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.527.309,89	4,45%	3.555.599.377,38	0,10%	7º III a
LF BRADESCO 05/02/2027 IPCA + 5,71%	2.689.965,09	3,39%	0,00		7º IV
LF BRADESCO 20/10/2025 IPCA + 6,22%	2.785.545,04	3,51%	0,00		7º IV
LF BRADESCO 21/07/2025 IPCA + 5,68%	1.129.721,04	1,43%	0,00		7º IV
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	80.815,56	0,10%	28.791.652,24	0,28%	7º V a
INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.041.415,58	1,31%	1.694.602.185,03	0,06%	7º V b
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	129.773,96	0,16%	257.278.195,81	0,05%	8º I
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	1.860.514,72	2,35%	702.472.570,99	0,26%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.025.585,04	1,29%	1.242.883.390,90	0,08%	8º I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.061.720,98	1,34%	501.604.392,08	0,21%	8º I
MAG BRASIL FI AÇÕES	8.374.350,00	10,56%	288.818.348,77	2,90%	8º I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	367.008,51	0,46%	161.074.696,91	0,23%	8º I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	964.389,86	1,22%	441.119.896,85	0,22%	8º I
QLZ MOS FI AÇÕES	2.732.981,77	3,45%	110.552.305,58	2,47%	8º I
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	828.464,79	1,05%	49.274.061,33	1,68%	9º III
LSH FIP MULTISTRATÉGIA	508.889,66	0,64%	107.190.396,24	0,47%	10º II
HAZ FII - ATCR11	1.540.465,40	1,94%	0,00		11º
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	240.765,23	0,30%	0,00		11º

Investimentos

\$ 79.273.935,19

Disponibilidades Financeiras

\$ 4.860.494,92

Total Carteira

\$ 84.134.430,11

Governança (Pró Gestão)

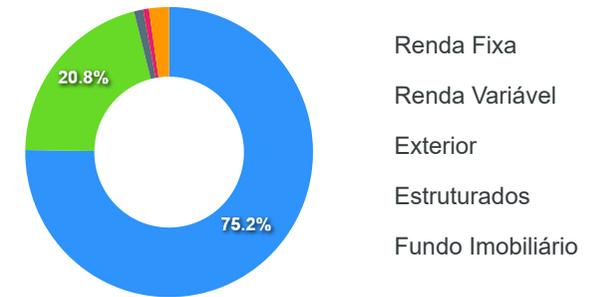
📄 NIVEL 1 14/06/2026

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	10,66% 8.446.991,56	89,34% 70.826.943,63
7º III a - FI Referenciados RF	65,00%	54,83% 43.464.571,40	10,17% 8.063.486,47
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	8,33% 6.605.231,17	11,67% 9.249.555,87
7º V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	0,10% 80.815,56	4,90% 3.882.881,20
7º V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	1,31% 1.041.415,58	3,69% 2.922.281,18
8º I - Fundos de Ações	35,00%	20,83% 16.516.324,84	14,17% 11.229.552,48
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,05% 828.464,79	8,95% 7.098.928,73
10º II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	0,64% 508.889,66	4,36% 3.454.807,10
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	2,25% 1.781.230,63	2,75% 2.182.466,13

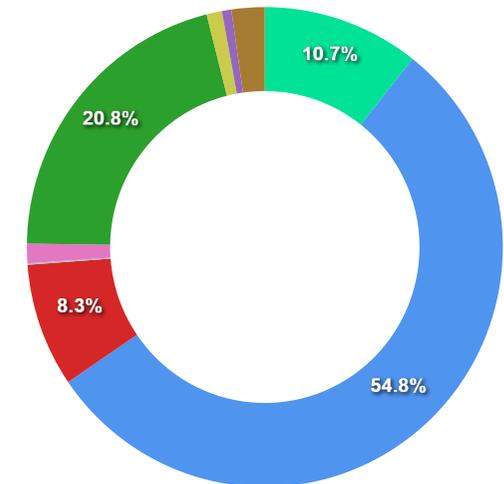
Governança (Pró Gestão)

🔗 NIVEL 1 14/06/2026

Segmentos



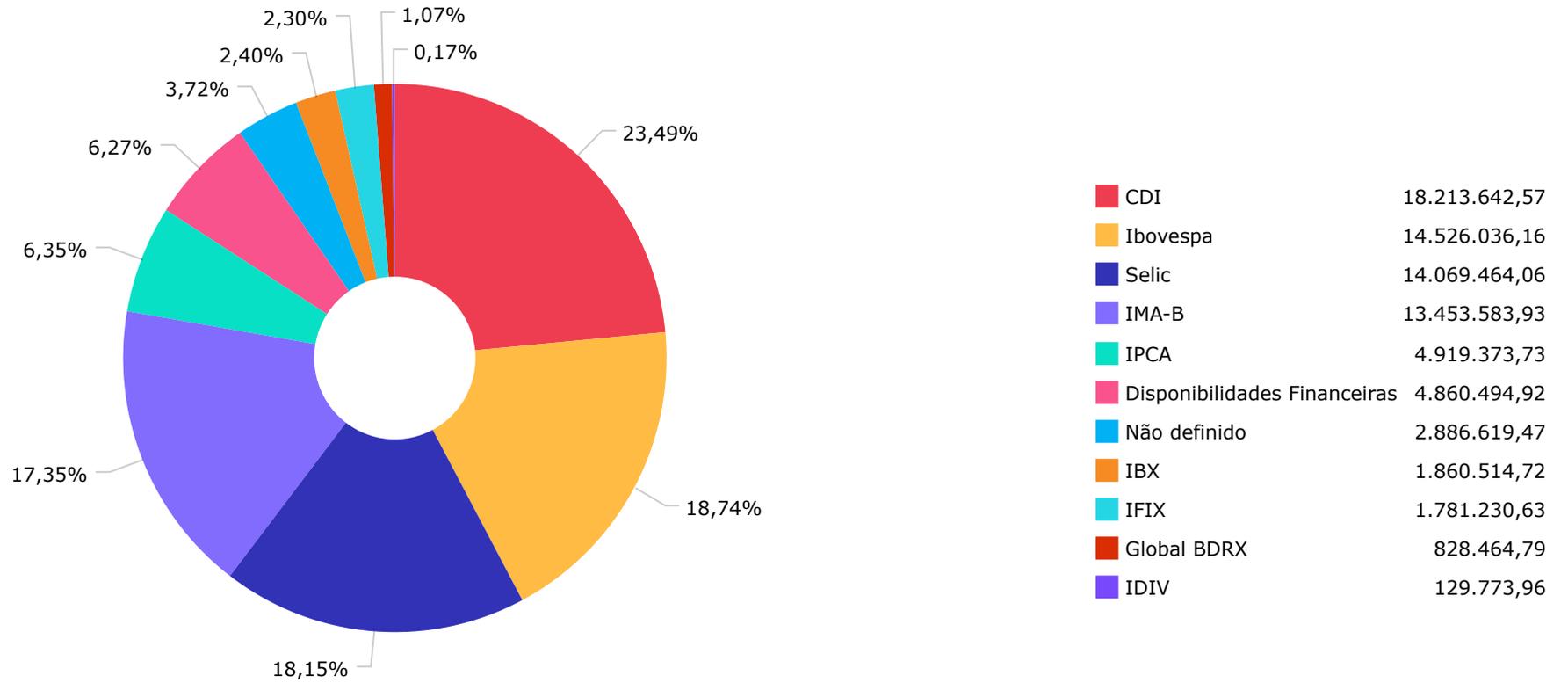
Artigos

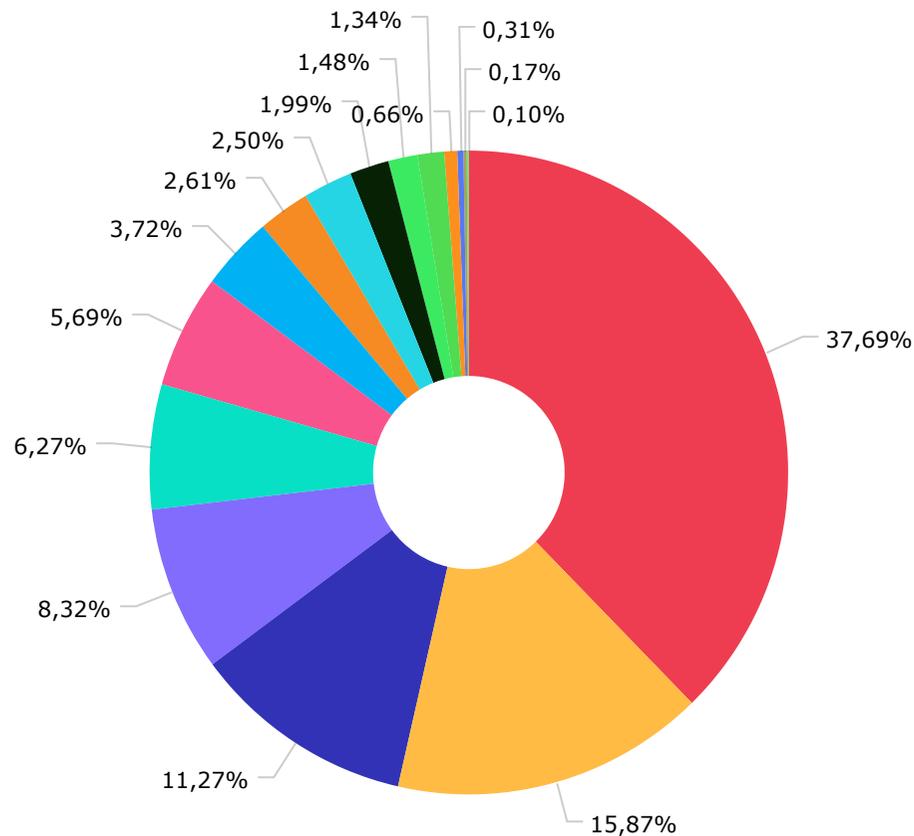


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	79.273.935,19	8° I - Fundos de Ações	20,83%	0,00%	20,00%	35,00%	11.229.552,48
7° I b - FI 100% Títulos TN	10,66%	0,00%	30,00%	100,00%	70.826.943,63	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	35,00%	27.745.877,32
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	79.273.935,19	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.927.393,52
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.963.696,76	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.927.393,52
7° III a - FI Referenciados RF	54,83%	0,00%	36,00%	65,00%	8.063.486,47	9° III - Ações - BDR Nível I	1,05%	0,00%	1,00%	10,00%	7.098.928,73
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	51.528.057,87	10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	7.927.393,52
7° IV - Ativos Financeiros de ...	8,33%	0,00%	3,00%	20,00%	9.249.555,87	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,64%	0,00%	1,00%	5,00%	3.454.807,10
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,10%	0,00%	1,00%	5,00%	3.882.881,20	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.963.696,76
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	1,31%	0,00%	1,00%	5,00%	2.922.281,18	11° - Fundos Imobiliários	2,25%	0,00%	3,00%	5,00%	2.182.466,13
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.963.696,76	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.963.696,76

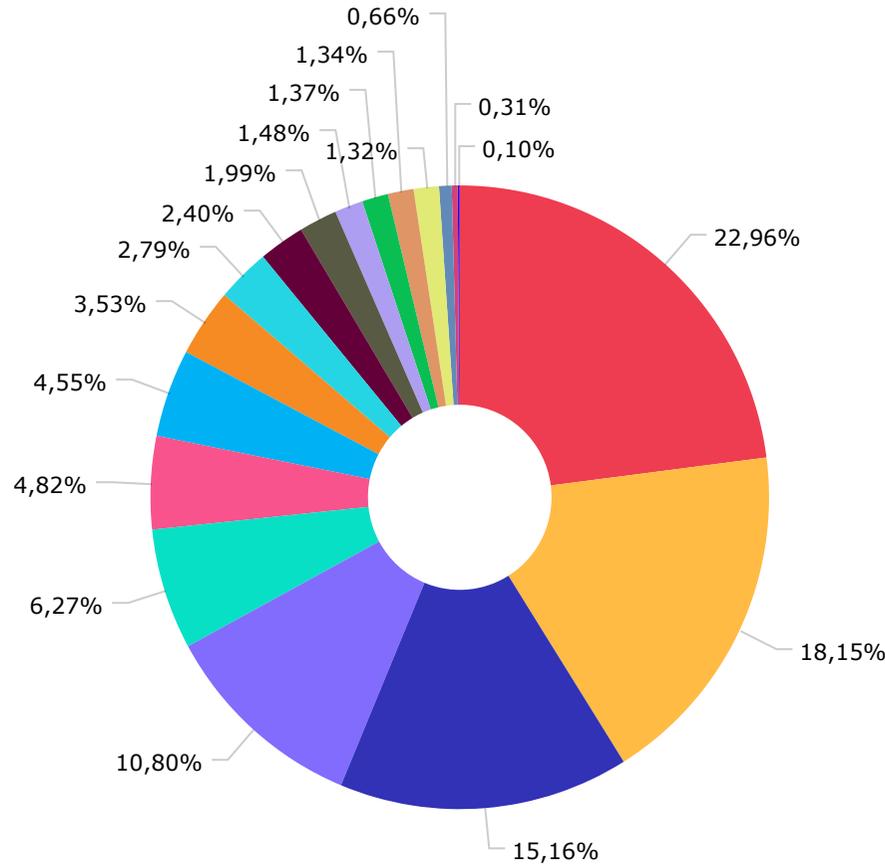
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	0,66	1,60	1,66	0,65	2,98		1,04	2,19
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,67						1,04	2,19
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	0,89		2,01				0,85	1,80
CDI - BENCHMARK								
	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87		
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,92	9,38	2,73	5,41	11,45	26,69	0,03	0,07
INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,94	9,31	2,70	5,41	11,37	26,79	0,01	0,03
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,91	9,23	2,67	5,40	11,31	26,50	0,02	0,04
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,85	8,10	2,40	4,75	9,90	23,39	0,03	0,06
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,49	-2,44	-1,28	-2,54	-7,57	-6,66	0,15	0,32
GLOBAL BDRX - BENCHMARK								
	6,02	50,50	6,38	29,14	64,77	95,02		
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,38	43,80	6,55	22,63	53,32	62,65	5,45	11,47
IBOVESPA - BENCHMARK								
	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79		
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-0,86	-0,30	5,42	6,13	19,05	18,61	4,90	10,32
QLZ MOS FI AÇÕES	-0,87	-4,56	0,30	4,88	15,46	23,64	5,99	12,61
MAG BRASIL FI AÇÕES	-1,67	-4,77	0,98	2,11	11,94	1,46	4,53	9,54
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,43	-5,47	1,26	1,87	10,99	1,39	4,13	8,69
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	-1,68	-6,50	-2,30	1,82	8,98	-0,73	4,75	10,01
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,78	-7,80	-1,97	0,70	6,58	8,25	4,50	9,47
IBX - BENCHMARK								
	-1,53	-2,74	1,84	2,99	15,29	11,28		
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	-1,66	-3,41	-1,40	0,48	13,23	2,45	4,74	9,99
IDIV - BENCHMARK								
	-1,72	2,45	4,09	7,11	21,24	28,86		

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,79	1,45	3,72	6,36	19,50	25,66	4,45	9,38
IMA-B - BENCHMARK	-0,65	0,16	-0,80	1,63	5,62	15,10		
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-0,70	-0,87	-0,97	1,08	4,78	11,12	1,88	3,96
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,86	-1,63	-1,16	1,02	3,78	11,82	1,84	3,87
IPCA - BENCHMARK	0,56	3,88	0,98	2,05	4,76	9,81		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,82	5,04	2,17	3,63	9,50	19,98	0,44	0,92
LSH FIP MULTISTRATÉGIA	-0,06	-0,63	-0,18	-0,38	-0,75	-1,51		
SELIC - BENCHMARK	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,93	9,68	2,75	5,56	11,80	27,41	0,02	0,05
IFIX - BENCHMARK	-3,06	-3,22	-4,75	-5,23	1,56	7,13		
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11								
HAZ FII - ATCR11								

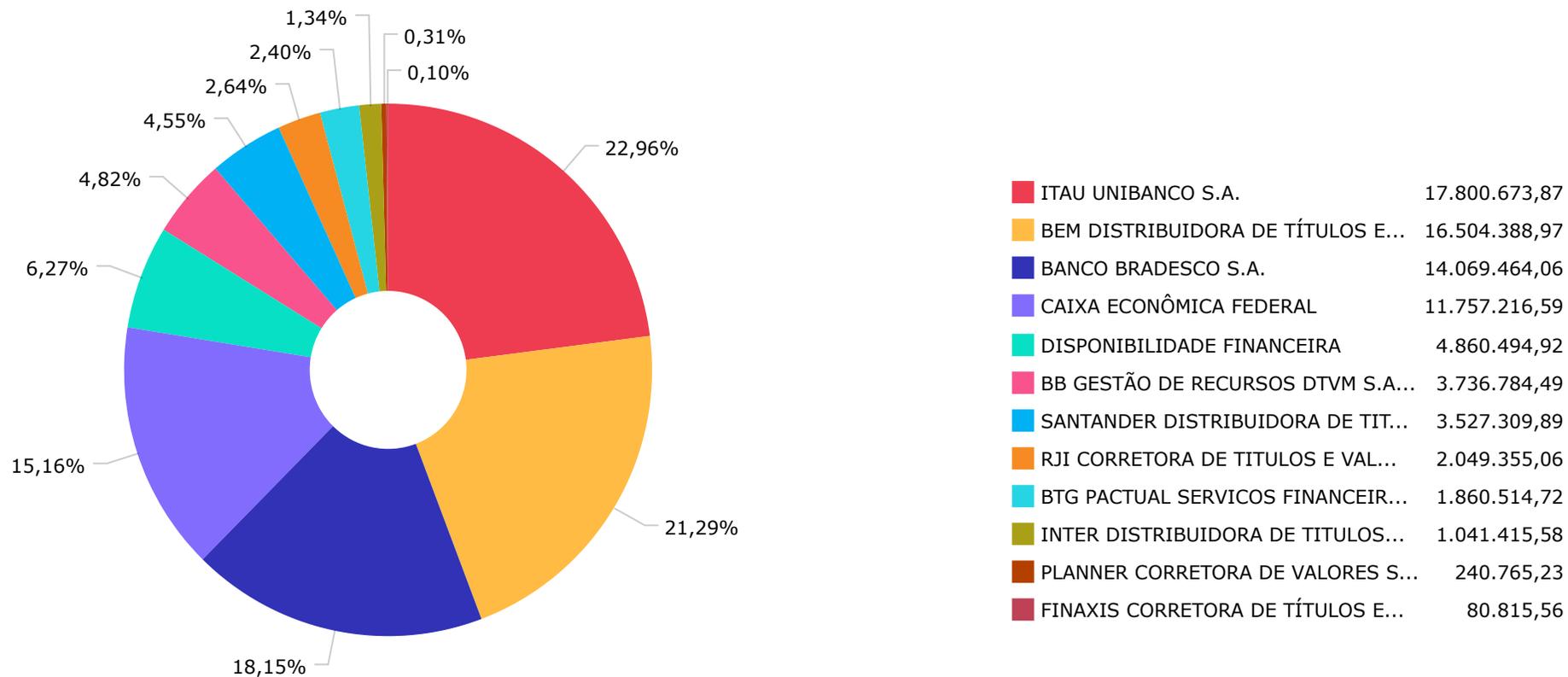




Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	29.224.216,58
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	12.303.695,91
Ações Índice Ativo	8.741.358,51
Ações Livre	6.447.546,32
Disponibilidades Financeiras	4.860.494,92
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	4.410.484,07
Não classificado	2.886.619,47
Ações Valor/Crescimento	2.026.110,84
Renda Fixa Simples	1.936.658,91
FII Desenvolvimento para Venda Gestão Ativa	1.540.465,40
Renda Fixa Duração Alta Soberano	1.149.888,02
Renda Fixa Duração Média Grau de Investimento	1.041.415,58
Fundos de Participações	508.889,66
FII Renda Gestão Ativa	240.765,23
Ações Dividendos	129.773,96
FIDC Outros	80.815,56



ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT...	17.800.673,87
BANCO BRADESCO S.A.	14.069.464,06
CAIXA DTVM	11.757.216,59
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS L...	8.374.350,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	4.860.494,92
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.736.784,49
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	3.527.309,89
MOS GESTÃO DE INVESTIMENTOS LT...	2.732.981,77
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	2.159.863,16
CLARITAS ADMINISTRAÇÃO DE RECU...	1.860.514,72
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.	1.540.465,40
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GEST...	1.149.888,02
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	1.061.720,98
INTER ASSET GESTAO DE RECURSOS...	1.041.415,58
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	1.025.585,04
RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL...	508.889,66
QLZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCE...	240.765,23
PETRA CAPITAL GESTÃO DE INVEST...	80.815,56



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%
Outubro	80.438.998,39	17.413.977,14	18.661.182,32	79.273.935,19	82.141,98	1.874.348,97	0,10% ▲	2,40%	1,04%	8,15%	29,45%	1,44%

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

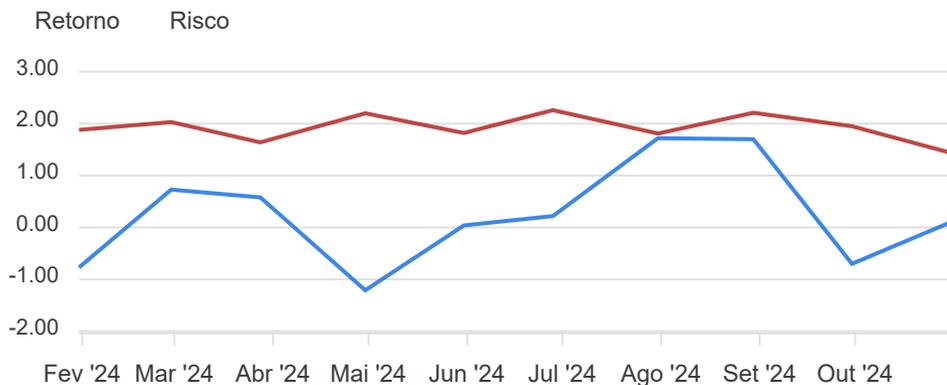
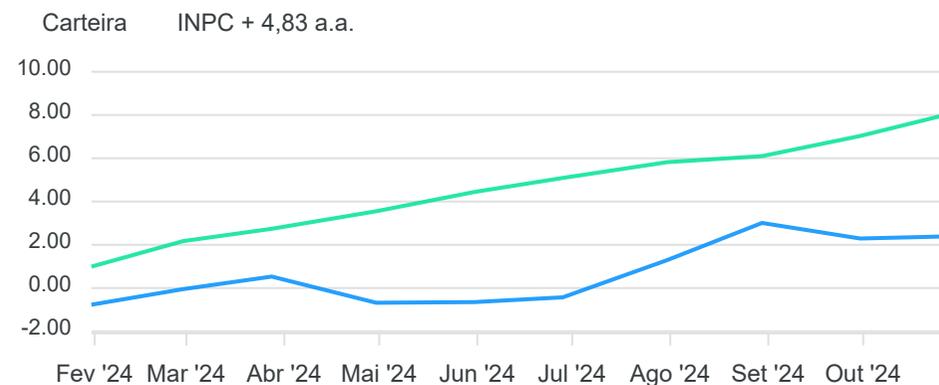
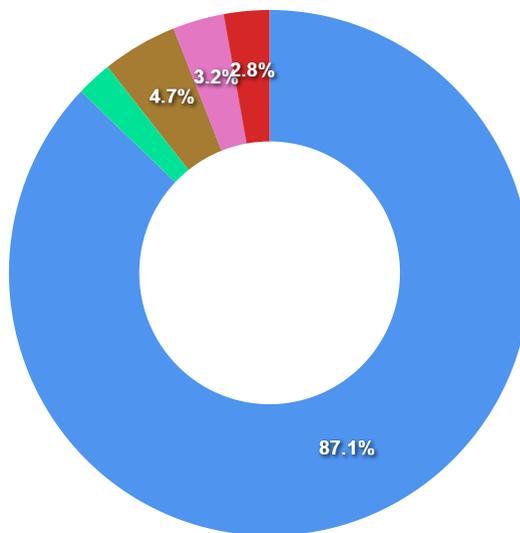


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/10/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	73.297.748,37	87,12
Até D+180	1.860.514,72	2,21
Até D+360	3.915.266,08	4,65
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	2.689.965,09	3,20
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	2.370.935,85	2,82



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	385.478,84	2.886.534,51	1.350.613,73	1.936.658,91	15.259,29	0,47% ▲	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	589.112,05	0,00	0,00	594.355,00	5.242,95	0,89% ▲	0,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 II RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.197.715,31	0,00	0,00	1.205.770,58	8.055,27	0,67% ▲	1,04%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	13.940.151,49	0,00	0,00	14.069.464,06	129.312,57	0,93% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.411.961,08	0,00	5.458.395,38	0,00	46.434,30	0,86% ▲	0,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.169.483,89	0,00	10.242.434,80	0,00	72.950,91	0,72% ▲	0,88%
INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.031.750,43	0,00	0,00	1.041.415,58	9.665,15	0,94% ▲	0,01%
ITAÚ ASSET NTN-B 2027 FI RENDA FIXA	1.079.316,86	0,00	0,00	1.086.493,89	7.177,03	0,66% ▲	1,04%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	12.411.001,84	0,00	0,00	12.303.695,91	-107.305,93	-0,86% ▼	1,84%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.374.601,16	0,00	0,00	4.410.484,07	35.882,91	0,82% ▲	0,44%
LF BRADESCO 05/02/2027 IPCA + 5,71%	2.666.619,07	0,00	0,00	2.689.965,09	23.346,02	0,88% ▲	-
LF BRADESCO 20/10/2025 IPCA + 6,22%	2.756.964,13	0,00	0,00	2.785.545,04	28.580,91	1,04% ▲	-
LF BRADESCO 21/07/2025 IPCA + 5,68%	1.118.676,60	0,00	0,00	1.129.721,04	11.044,44	0,99% ▲	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	81.211,36	0,00	0,00	80.815,56	-395,80	-0,49% ▼	0,15%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.017.937,52	2.500.000,00	0,00	3.527.309,89	9.372,37	0,27% ▲	0,03%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1.157.938,37	0,00	0,00	1.149.888,02	-8.050,35	-0,70% ▼	1,88%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	11.627.442,63	0,00	11.627.442,63	0,00	0,00%	0,02%
	59.389.920,00	17.013.977,14	17.051.443,91	59.639.025,27	286.572,04	0,48%	0,51%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	132.142,87	0,00	0,00	129.773,96	-2.368,91	-1,79% ▼	4,45%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	1.891.894,84	0,00	0,00	1.860.514,72	-31.380,12	-1,66% ▼	4,74%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.040.428,96	0,00	0,00	1.025.585,04	-14.843,92	-1,43% ▼	4,13%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.070.919,64	0,00	0,00	1.061.720,98	-9.198,66	-0,86% ▼	4,90%
MAG BRASIL FI AÇÕES	8.516.507,05	0,00	0,00	8.374.350,00	-142.157,05	-1,67% ▼	4,53%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	373.266,20	0,00	0,00	367.008,51	-6.257,69	-1,68% ▼	4,75%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	981.904,31	0,00	0,00	964.389,86	-17.514,45	-1,78% ▼	4,50%
QLZ MOS FI AÇÕES	2.756.829,31	0,00	0,00	2.732.981,77	-23.847,54	-0,87% ▼	5,99%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.592.977,46	0,00	1.604.971,56	0,00	11.994,10	0,75% ▲	5,71%
-	18.356.870,64	0,00	1.604.971,56	16.516.324,84	-235.574,24	-1,28%	4,80%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	509.198,67	0,00	0,00	508.889,66	-309,01	-0,06% ▼	-
-	509.198,67	0,00	0,00	508.889,66	-309,01	-0,06%	0,00%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
HAZ FII - ATCR11	1.544.249,85	0,00	4.766,85	1.540.465,40	982,40	0,06% ▲	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	243.138,83	0,00	0,00	240.765,23	-2.373,60	-0,98% ▼	-
-	1.787.388,68	0,00	4.766,85	1.781.230,63	-1.391,20	-0,08%	0,00%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
PLURAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	395.620,40	400.000,00	0,00	828.464,79	32.844,39	4,13% ▲	5,45%
	395.620,40	400.000,00	0,00	828.464,79	32.844,39	4,13%	0,00%

Cenário Econômico

O mês de outubro foi marcado por alta volatilidade. Na renda fixa, os fundos ligados à inflação mais longa continuam apresentando performance negativa devido à abertura da curva de juros, enquanto os demais ativos fecharam no positivo. Já os fundos de renda variável local registraram rentabilidade negativa, com mais um mês ruim para a bolsa de valores (Ibovespa) diante das incertezas em relação a política fiscal e a necessidade de redução de gastos. Por fim, no segmento de investimentos no exterior, a elevação do dólar frente ao real proporcionou rentabilidade positiva para boa parte dos fundos.

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.

Retorno da Carteira de Investimentos

Como já dissemos, o mês de outubro foi marcado por alta volatilidade e terminou com resultados mistos. Na renda fixa, os fundos ligados à inflação mais longa fecharam mais um mês no negativo devido à abertura da curva de juros, enquanto os demais ativos fecharam no positivo. Já os fundos de renda variável local registraram rentabilidade negativa, com mais um mês ruim para a bolsa de valores (Ibovespa). Por fim, no segmento de investimentos no exterior, mesmo com o desempenho negativo no exterior, a elevação do dólar frente ao real proporcionou rentabilidade positiva para boa parte dos fundos.

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 novembro 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 **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 **PREVIGUABA IGUABA GRANDE - RJ** 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 **PREVIGUABA IGUABA GRANDE - RJ** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

