

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
TÍTULOS PÚBLICOS	11.100.685,60	10,13%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.951.515,95	1,78%	6.153.638.080,30	0,03%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	560.652,15	0,51%	4.321.577.868,21	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	818.153,49	0,75%	1.281.838.623,25	0,06%	7º I b
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.416.932,13	2,21%	218.317.444,64	1,11%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.486.833,33	1,36%	4.436.237.468,68	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	784.382,07	0,72%	4.168.680.215,13	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.777.354,67	1,62%	6.913.810.528,18	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.593.385,12	12,40%	3.720.203.081,78	0,37%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.292.643,87	7,57%	8.159.464.453,76	0,10%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.492,87	0,04%	11.229.374.861,63	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.184.477,32	2,91%	1.856.541.125,92	0,17%	7º I b
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	16.816.874,57	15,35%	635.919.188,76	2,64%	7º III a
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.188.238,30	18,42%	12.313.879.816,55	0,16%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.333.399,16	1,22%	1.021.358.141,89	0,13%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	574.615,91	0,52%	6.684.632.943,63	0,01%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.983.701,79	2,72%	3.331.476.040,52	0,09%	7º III a
LF ITAÚ UNIBANCO 02/05/2029 IPCA + 6,31%	783.124,68	0,71%	0,00		7º IV
LF ITAÚ UNIBANCO 05/05/2028 IPCA + 6,22%	782.876,70	0,71%	0,00		7º IV
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.762.104,81	1,61%	645.563.640,82	0,27%	8º I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	3.003.054,43	2,74%	268.811.030,58	1,12%	8º I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.867.628,36	1,70%	315.351.858,83	0,59%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	890.323,97	0,81%	1.363.618.286,22	0,07%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.308.557,00	3,02%	529.758.123,01	0,62%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.373.531,55	2,17%	253.323.501,90	0,94%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.282.872,49	1,17%	1.370.744.573,46	0,09%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.949.905,87	1,78%	1.484.135.820,17	0,13%	8º I

Investimentos

\$ 109.582.741,55

Disponibilidades Financeiras

\$ 625.240,55

Total Carteira

\$ 110.207.982,10

Governança (Pró Gestão)

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	787.777,07	0,72%	120.368.019,54	0,65%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	343.944,08	0,31%	139.753.891,10	0,25%	8º I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	221.328,38	0,20%	64.540.444,18	0,34%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.322.373,86	2,12%	2.640.148.103,06	0,09%	9º III

Investimentos

 109.582.741,55

Disponibilidades Financeiras

 625.240,55

Total Carteira

 110.207.982,10

Governança (Pró Gestão)



Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	10/12/2021	Curva - Taxa: 5,0200%	29	4.572,205773	132.593,97
NTN-B - 15/05/2035	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,6800%	20	4.894,53114	97.890,62
NTN-B - 15/08/2040	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7500%	49	4.954,713647	242.780,97
NTN-B - 15/05/2045	26/03/2020	Curva - Taxa: 4,5500%	146	5.253,870607	767.065,11
NTN-B - 15/05/2045	09/09/2021	Curva - Taxa: 4,8600%	351	5.062,495596	1.776.935,95
NTN-B - 15/05/2045	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	72	5.123,127807	368.865,20
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2019	Curva - Taxa: 4,4000%	122	5.417,744487	660.964,83
NTN-B - 15/08/2050	31/03/2020	Curva - Taxa: 4,4600%	71	5.372,376268	381.438,72
NTN-B - 15/08/2050	02/04/2020	Curva - Taxa: 4,5900%	146	5.275,962318	770.290,50
NTN-B - 15/08/2050	06/04/2020	Curva - Taxa: 4,6800%	123	5.210,681724	640.913,85
NTN-B - 15/08/2050	08/04/2020	Curva - Taxa: 4,6300%	122	5.246,800741	640.109,69
NTN-B - 15/08/2050	09/04/2020	Curva - Taxa: 4,7300%	124	5.174,925929	641.690,82
NTN-B - 15/08/2050	15/05/2020	Curva - Taxa: 4,6400%	147	5.239,549263	770.213,74
NTN-B - 15/08/2050	23/11/2020	Curva - Taxa: 4,3400%	3	5.463,670511	16.391,01
NTN-B - 15/08/2050	10/03/2021	Curva - Taxa: 4,1500%	19	5.612,868473	106.644,50
NTN-B - 15/08/2050	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7800%	69	5.139,529032	354.627,50
NTN-B - 15/08/2050	15/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	29	4.455,027604	129.195,80
NTN-B - 15/05/2055	01/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	359	5.286,469826	1.897.842,67
NTN-B - 15/05/2055	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,8000%	134	5.255,448895	704.230,15

Investimentos

\$ 109.582.741,55

Disponibilidades Financeiras

\$ 625.240,55

Total Carteira

\$ 110.207.982,10

Governança (Pró Gestão)

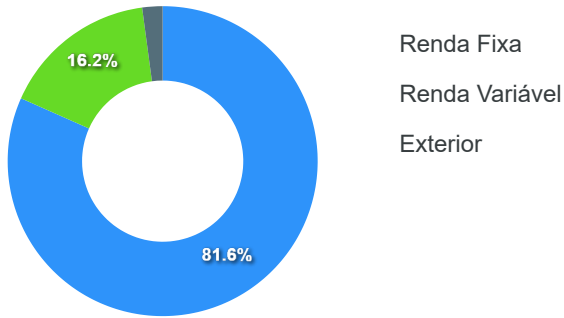


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	10,07%	11.100.685,60 89,93%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	31,67%	34.905.822,97 68,33%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	38,02%	41.896.829,73 21,98%
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	1,42%	1.566.001,38 18,58%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	16,14%	17.791.028,01 13,86%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	2,11%	2.322.373,86 7,89%

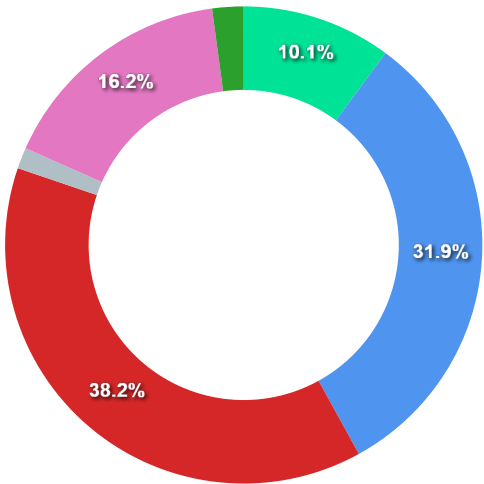
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



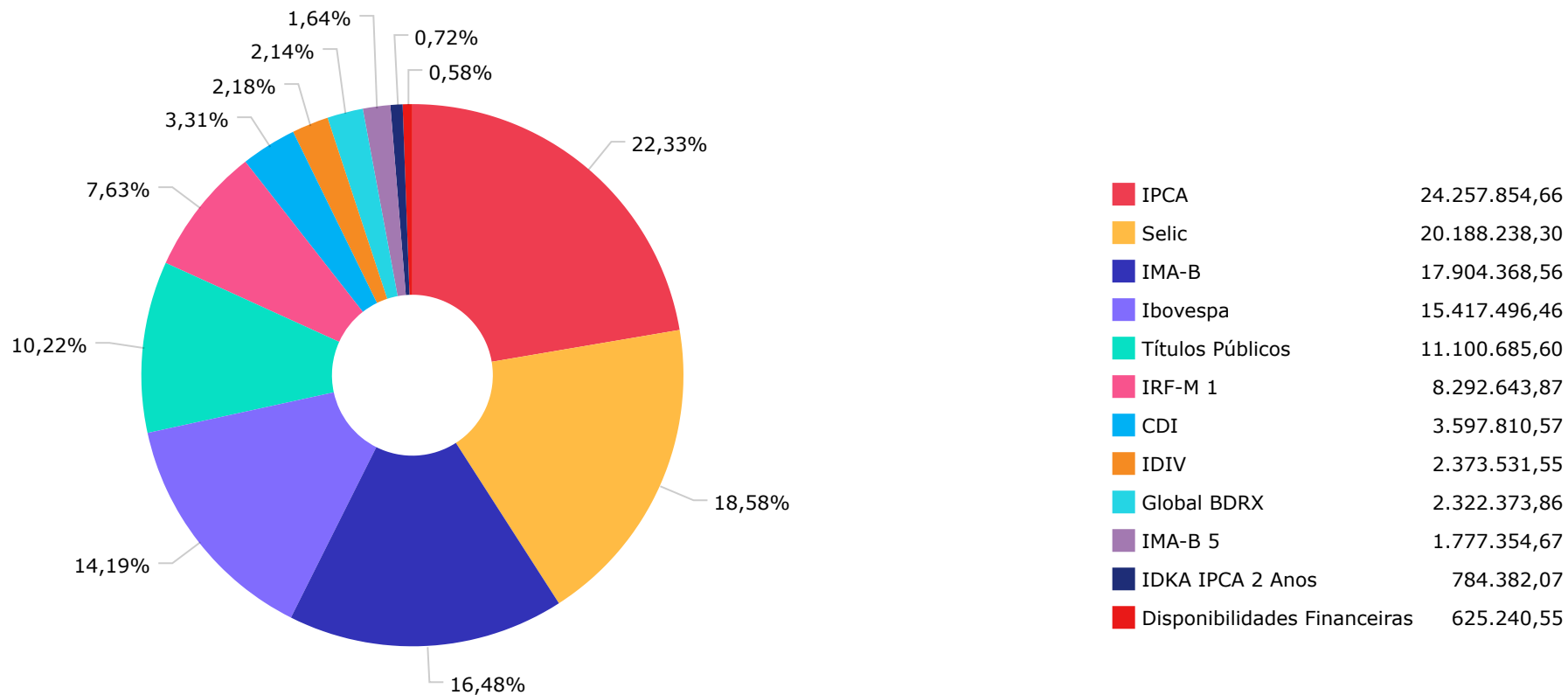
Artigos

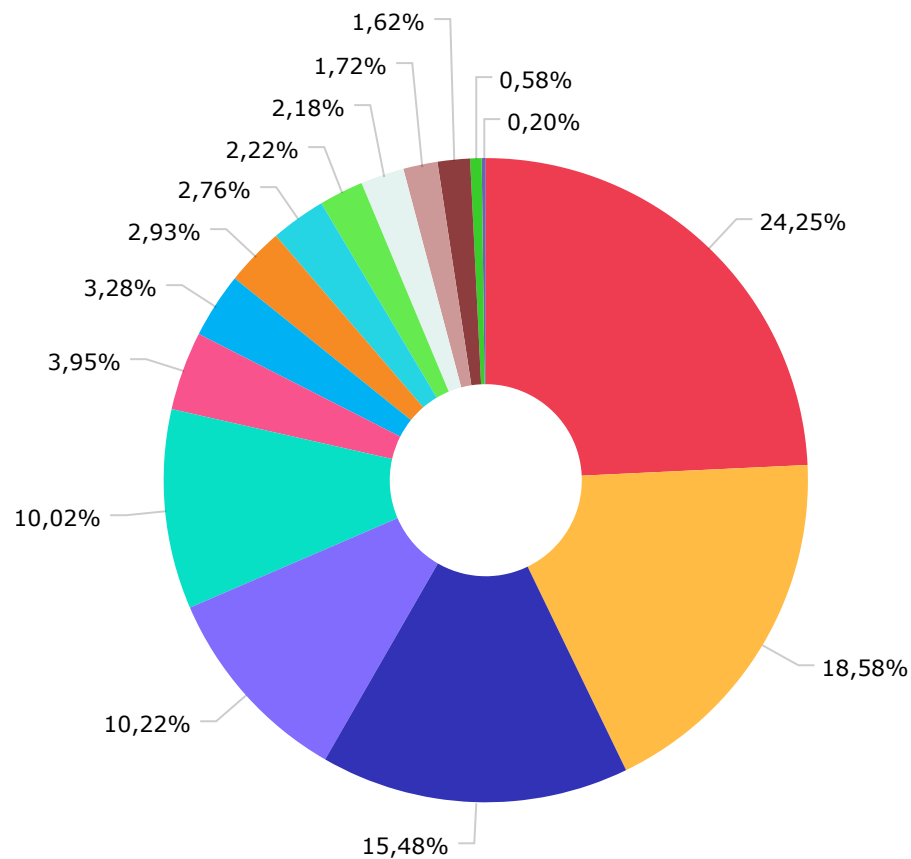


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	10,07%	0,00%	12,00%	100,00%	99.107.296,50	8º I - Fundos de Ações	16,14%	0,00%	20,00%	30,00%	15.271.366,62
7º I b - FI 100% Títulos TN	31,67%	0,00%	24,00%	100,00%	75.302.159,13	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	33.062.394,63
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	110.207.982,10	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	11.020.798,21
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.510.399,11	9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	11.020.798,21
7º III a - FI Referenciados RF	38,02%	0,00%	33,00%	60,00%	24.227.959,53	9º III - Ações - BDR Nível I	2,11%	0,00%	2,00%	10,00%	8.698.424,35
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	66.124.789,26	10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	11.020.798,21
7º IV - Ativos Financeiros de ...	1,42%	0,00%	1,00%	20,00%	20.475.595,04	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.510.399,11
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.510.399,11	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.510.399,11
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.510.399,11	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.510.399,11
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.510.399,11	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.510.399,11

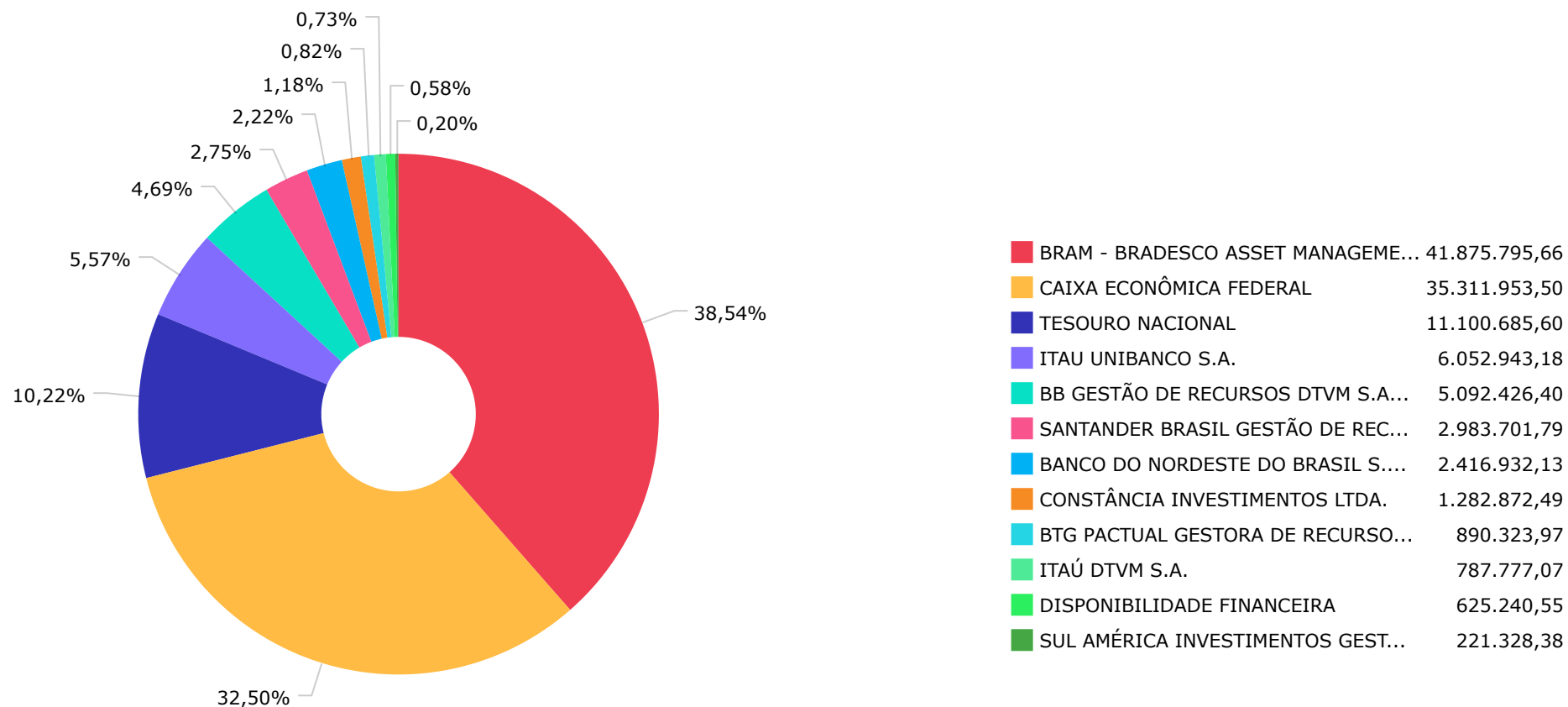
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98		
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,86	8,36	2,72	5,41	11,64	27,15	0,02	0,05
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88	8,38	2,75	5,44	11,55	26,85	0,03	0,06
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83	7,77	2,64	5,08	10,77	25,55	0,02	0,04
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	-0,21	41,96	0,63	22,50	52,98	86,40		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,32	40,56	0,75	22,25	51,31	81,77	8,93	18,80
IBOVESPA - BENCHMARK	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79		
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,97	11,17	12,08	9,59	29,31	27,61	6,04	12,73
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	-3,09	-1,82	6,41	2,91	13,09	19,94	5,82	12,26
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-3,37	-1,56	5,79	2,74	12,29	17,03	5,70	12,01
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-3,29	-2,79	5,82	0,55	10,39	14,49	5,48	11,54
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-2,45	-4,11	6,25	-2,52	7,33	8,42	4,72	9,95
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-2,95	-4,43	6,30	-1,56	6,67	5,89	5,63	11,85
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-2,32	-7,65	6,55	-4,77	3,34	2,93	5,32	11,20
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,06	-6,56	3,12	-3,79	3,20	4,83	5,85	12,32
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,84	-8,77	1,07	-8,03	2,92	1,47	6,13	12,91
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-3,21	-9,89	5,97	-4,72	-1,66	-12,59	5,61	11,81
IDIV - BENCHMARK	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,78	3,31	7,45	7,59	17,87	32,87	5,39	11,35
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,39	5,01	1,75	2,72	8,05	20,40		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,40	4,73	1,72	2,60	7,72	19,96	0,92	1,94
IMA-B - BENCHMARK	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28		

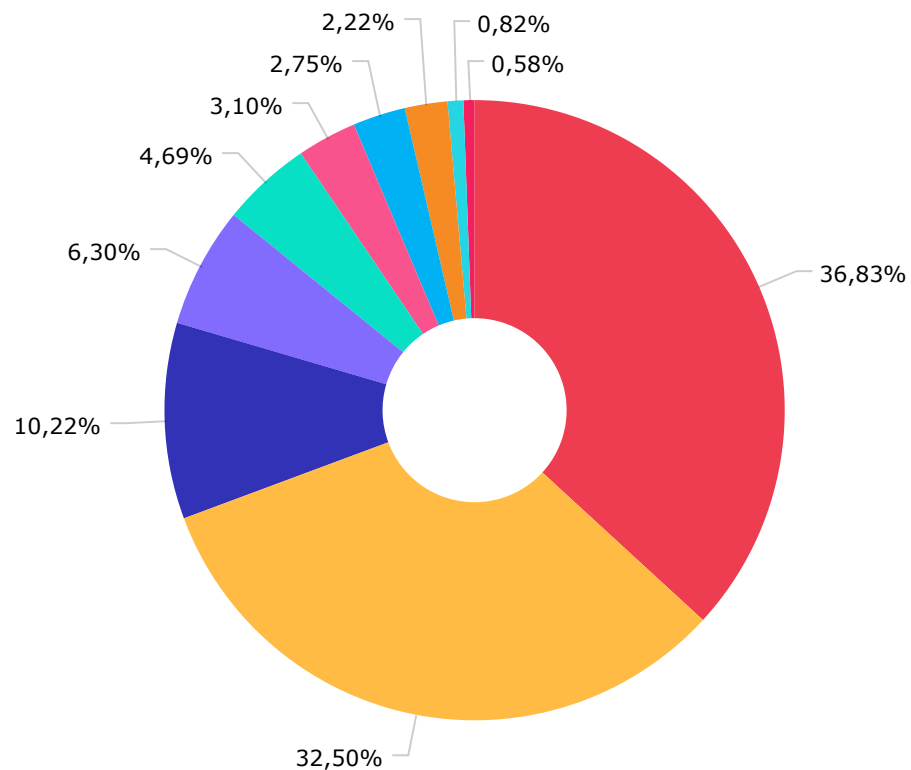
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,55	0,98	1,98	0,88	5,92	17,54	1,71	3,60
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,64	0,81	2,14	0,61	5,61	16,86	1,79	3,78
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,69	0,63	1,88	0,50	5,37	16,71	1,87	3,93
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,69	0,60	1,84	0,49	5,34	16,66	1,86	3,93
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		
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71	6,65	2,71	4,15	9,77	24,69	0,18	0,37
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,63	4,18	2,23	2,55	8,39	20,05	0,50	1,06
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,31	4,03	2,19	2,47	7,82	21,65	0,89	1,87
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,52	4,59	2,18	2,74	7,65	21,44	0,56	1,18
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30	3,90	1,89	2,11	7,25	19,41	1,13	2,37
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	0,30
SELIC - BENCHMARK	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98		
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,81	7,81	2,58	5,12	10,77	25,36	0,01	0,02





Renda Fixa Indexados	26.341.817,04
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	20.188.238,30
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	16.816.874,57
Títulos Públicos	11.100.685,60
Ações Livre	10.885.754,34
Renda Fixa Duração Livre Soberano	4.295.995,64
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	3.558.317,70
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	3.184.477,32
Ações Indexados	3.003.054,43
Renda Fixa Duração Alta Soberano	2.416.932,13
Ações Dividendos	2.373.531,55
Ações Índice Ativo	1.867.628,36
Ações Sustentabilidade/Governança	1.762.104,81
Disponibilidades Financeiras	625.240,55
Ações Valor/Crescimento	221.328,38





BANCO BRADESCO S.A.	40.008.167,30
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	35.311.953,50
TESOURO NACIONAL	11.100.685,60
ITAU UNIBANCO S.A.	6.840.720,25
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	5.092.426,40
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	3.371.829,23
SANTANDER DISTRIBUIDORA DE TIT...	2.983.701,79
S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA...	2.416.932,13
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	890.323,97
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	625.240,55

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	95.999.136,54	1.530.719,12	81.000,00	97.025.811,90	-423.043,76	-423.043,76	-0,43% ▼	-0,43%	0,85%	0,85%	-50,59%	2,35%
Fevereiro	97.025.811,90	855.842,25	68.000,00	98.905.748,95	1.092.094,80	669.051,04	1,12% ▲	0,68%	1,20%	2,06%	33,01%	2,30%
Março	98.905.748,95	18.537.508,23	17.324.999,23	100.722.697,45	604.439,50	1.273.490,54	0,60% ▲	1,29%	0,55%	2,62%	49,24%	1,60%
Abril	100.722.697,45	4.446.055,88	5.087.843,25	99.279.189,39	-801.720,69	471.769,85	-0,80% ▼	0,48%	0,81%	3,45%	13,91%	1,87%
Mai	99.279.189,39	2.475.565,57	360.294,08	101.780.955,77	386.494,89	858.264,74	0,38% ▲	0,86%	0,87%	4,35%	19,77%	1,45%
Junho	101.780.955,77	1.485.329,78	627.900,00	103.155.683,46	517.297,91	1.375.562,65	0,50% ▲	1,37%	0,60%	4,98%	27,51%	1,89%
Julho	103.155.683,46	5.061.647,55	3.466.672,45	106.312.510,51	1.561.851,95	2.937.414,60	1,49% ▲	2,88%	0,83%	5,85%	49,23%	1,72%
Agosto	106.312.510,51	1.879.862,57	910.340,79	108.900.028,24	1.617.995,95	4.555.410,55	1,51% ▲	4,43%	0,41%	6,28%	70,54%	1,92%
Setembro	108.900.028,24	1.480.787,53	606.550,00	109.582.741,55	-191.524,22	4.363.886,33	-0,17% ▼	4,25%	0,85%	7,18%	59,19%	1,61%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	1.273.490,54	1,29%	2,62%
2º Trim	102.072,11	0,08%	2,30%
1º Sem	1.375.562,65	1,37%	4,98%
3º Trim	2.988.323,68	2,84%	2,10%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

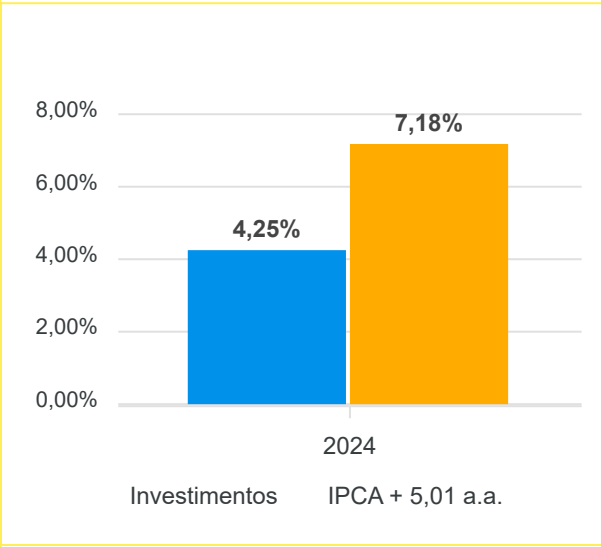


Gráfico Risco x Retorno

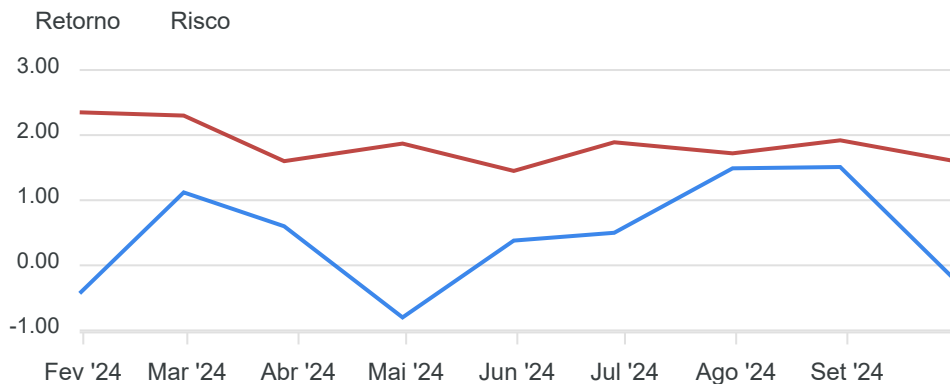
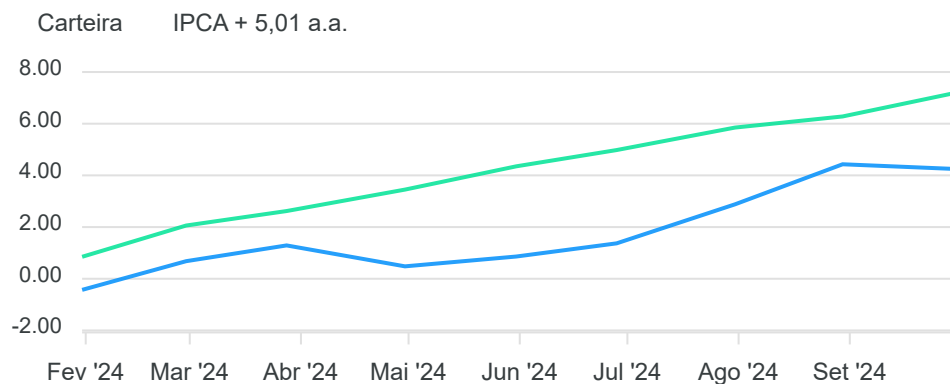
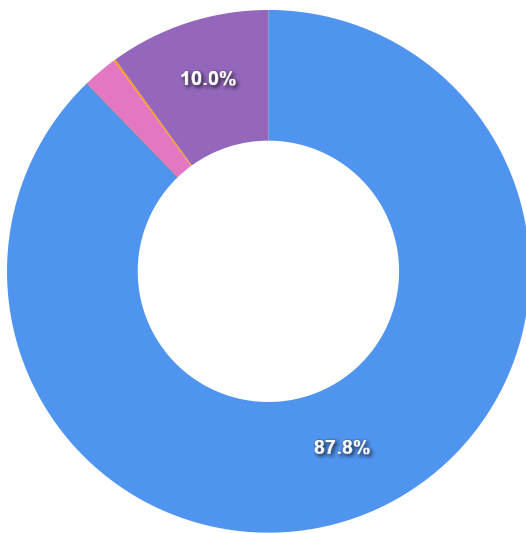


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/09/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	96.723.141,63	88,26
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	2.384.154,87	2,18
Até D+3600	132.593,97	0,12
Acima D+3600	10.968.091,63	10,01
Indeterminado	0,00	0,00



RENTA FIJA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	11.036.830,63	0,00	0,00	11.100.685,60	63.854,97	0,58% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	1.937.819,29	0,00	0,00	1.951.515,95	13.696,66	0,71% ▲	0,18%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	564.523,20	0,00	0,00	560.652,15	-3.871,05	-0,69% ▼	1,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	815.679,34	0,00	0,00	818.153,49	2.474,15	0,30% ▲	1,13%
BNB RPPS IMA-B FI RENTA FIJA	2.430.278,17	0,00	0,00	2.416.932,13	-13.346,04	-0,55% ▼	1,71%
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIJA	16.764.912,41	0,00	0,00	16.816.874,57	51.962,16	0,31% ▲	0,89%
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	20.026.020,51	0,00	0,00	20.188.238,30	162.217,79	0,81% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIJA	1.479.074,83	0,00	0,00	1.486.833,33	7.758,50	0,52% ▲	0,56%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	781.283,78	0,00	0,00	784.382,07	3.098,29	0,40% ▲	0,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	1.770.593,24	0,00	0,00	1.777.354,67	6.761,43	0,38% ▲	0,96%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	13.687.559,66	0,00	0,00	13.593.385,12	-94.174,54	-0,69% ▼	1,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA	7.355.984,04	874.000,00	0,00	8.292.643,87	62.659,83	0,76% ▲	0,14%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	39.166,65	0,00	0,00	39.492,87	326,22	0,83% ▲	0,02%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO IMA-B LP	1.341.966,23	0,00	0,00	1.333.399,16	-8.567,07	-0,64% ▼	1,79%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIJA	3.164.444,84	0,00	0,00	3.184.477,32	20.032,48	0,63% ▲	0,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	569.720,78	0,00	0,00	574.615,91	4.895,13	0,86% ▲	0,02%
LF ITAÚ UNIBANCO 02/05/2029 IPCA + 6,31%	778.952,43	0,00	0,00	783.124,68	4.172,25	0,54% ▲	-
LF ITAÚ UNIBANCO 05/05/2028 IPCA + 6,22%	778.756,40	0,00	0,00	782.876,70	4.120,30	0,53% ▲	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENTA FIJA REFERENCIADO DI	2.955.574,30	606.787,53	606.550,00	2.983.701,79	27.889,96	0,78% ▲	0,03%
	88.279.140,73	1.480.787,53	606.550,00	89.469.339,68	315.961,42	0,35%	0,62%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.823.639,15	0,00	0,00	1.762.104,81	-61.534,34	-3,37% ▼	5,70%
BRABESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	3.098.713,66	0,00	0,00	3.003.054,43	-95.659,23	-3,09% ▼	5,82%
BRABESCO SELECTION FIAÇÕES	1.912.074,60	0,00	0,00	1.867.628,36	-44.446,24	-2,32% ▼	5,32%
BIG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	935.652,23	0,00	0,00	890.323,97	-45.328,26	-4,84% ▼	6,13%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.448.721,77	0,00	0,00	3.308.557,00	-140.164,77	-4,06% ▼	5,85%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.392.262,99	0,00	0,00	2.373.531,55	-18.731,44	-0,78% ▼	5,39%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.315.041,63	0,00	0,00	1.282.872,49	-32.169,14	-2,45% ▼	4,72%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.968.916,81	0,00	0,00	1.949.905,87	-19.010,94	-0,97% ▼	6,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	811.728,10	0,00	0,00	787.777,07	-23.951,03	-2,95% ▼	5,63%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	355.340,74	0,00	0,00	343.944,08	-11.396,66	-3,21% ▼	5,61%
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	228.864,68	0,00	0,00	221.328,38	-7.536,30	-3,29% ▼	5,48%
-	18.290.956,36	0,00	0,00	17.791.028,01	-499.928,35	-2,73%	5,65%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.329.931,15	0,00	0,00	2.322.373,86	-7.557,29	-0,32% ▼	8,93%
	2.329.931,15	0,00	0,00	2.322.373,86	-7.557,29	-0,32%	0,00%

RENTA FIJA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	1.899.964,53	0,00	0,00	1.951.515,95	51.551,42	2,71% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	550.504,49	0,00	0,00	560.652,15	10.147,66	1,84% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO	802.955,61	0,00	0,00	818.153,49	15.197,88	1,89% ▲
BNB RPPS IMA-B FI RENTA FIJA	2.369.949,69	0,00	0,00	2.416.932,13	46.982,44	1,98% ▲
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIJA	16.456.993,07	0,00	0,00	16.816.874,57	359.881,50	2,19% ▲
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	17.944.782,81	1.797.988,82	50.000,00	20.188.238,30	495.466,67	2,51% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENTA FIJA	1.692.415,90	0,00	1.726.353,53	0,00	33.937,63	2,01% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIJA	1.455.104,28	0,00	0,00	1.486.833,33	31.729,05	2,18% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	771.091,52	0,00	0,00	784.382,07	13.290,55	1,72% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	1.744.793,86	0,00	0,00	1.777.354,67	32.560,81	1,87% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	13.342.967,39	0,00	0,00	13.593.385,12	250.417,73	1,88% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA	7.234.154,56	874.000,00	0,00	8.292.643,87	184.489,31	2,28% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP	38.478,86	0,00	0,00	39.492,87	1.014,01	2,64% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENTA FIJA REFERENCIADO IMA-B LP	1.305.465,20	0,00	0,00	1.333.399,16	27.933,96	2,14% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENTA FIJA	3.114.959,71	0,00	0,00	3.184.477,32	69.517,61	2,23% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENTA FIJA REFERENCIADO DI	0,00	567.417,35	0,00	574.615,91	7.198,56	1,27% ▲
LF ITAÚ UNIBANCO 02/05/2029 IPCA + 6,31%	766.109,47	0,00	0,00	783.124,68	17.015,21	2,22% ▲
LF ITAÚ UNIBANCO 05/05/2028 IPCA + 6,22%	766.017,89	0,00	0,00	782.876,70	16.858,81	2,20% ▲
SANTANDER ATIVO FIC RENTA FIJA	803.189,71	0,00	809.706,52	0,00	6.516,81	0,81% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENTA FIJA REFERENCIADO DI	1.026,95	5.182.891,48	2.263.162,40	2.983.701,79	62.945,76	1,21% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	11.028.796,01	0,00	134.340,79	11.100.685,60	206.230,38	1,87% ▲
	84.089.721,51	8.422.297,65	4.983.563,24	89.469.339,68	1.940.883,76	2,22%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.665.726,46	0,00	0,00	1.762.104,81	96.378,35	5,79% ▲
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.822.031,22	0,00	0,00	3.003.054,43	181.023,21	6,41% ▲
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.752.762,76	0,00	0,00	1.867.628,36	114.865,60	6,55% ▲
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	880.922,34	0,00	0,00	890.323,97	9.401,63	1,07% ▲
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.208.507,54	0,00	0,00	3.308.557,00	100.049,46	3,12% ▲
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.208.918,86	0,00	0,00	2.373.531,55	164.612,69	7,45% ▲
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.207.374,03	0,00	0,00	1.282.872,49	75.498,46	6,25% ▲
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.739.799,06	0,00	0,00	1.949.905,87	210.106,81	12,08% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	741.070,42	0,00	0,00	787.777,07	46.706,65	6,30% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	324.576,78	0,00	0,00	343.944,08	19.367,30	5,97% ▲
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	209.152,24	0,00	0,00	221.328,38	12.176,14	5,82% ▲
	16.760.841,71	0,00	0,00	17.791.028,01	1.030.186,30	6,15%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.305.120,24	0,00	0,00	2.322.373,86	17.253,62	0,75% ▲
	2.305.120,24	0,00	0,00	2.322.373,86	17.253,62	0,75%

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

