

# 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      |
|----------------------------------------------------------------------|---------------|------------|-------------------|-------|----------|
| TÍTULOS PÚBLICOS                                                     | 11.204.005,60 | 10,08%     | 0,00              |       | 7º I a   |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 1.966.118,42  | 1,77%      | 6.119.978.979,94  | 0,03% | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE... | 544.826,45    | 0,49%      | 3.760.040.315,03  | 0,01% | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 823.565,90    | 0,74%      | 1.290.318.483,15  | 0,06% | 7º I b   |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA                                         | 2.403.420,78  | 2,16%      | 212.891.477,35    | 1,13% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                       | 495.510,35    | 0,45%      | 4.085.747.193,68  | 0,01% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 790.334,74    | 0,71%      | 4.039.305.995,01  | 0,02% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP               | 285.190,76    | 0,26%      | 6.810.595.873,00  | 0,00% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                 | 579.100,82    | 0,52%      | 3.355.089.991,95  | 0,02% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                  | 26.943.849,06 | 24,24%     | 8.121.204.821,20  | 0,33% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                       | 39.869,11     | 0,04%      | 11.268.222.308,52 | 0,00% | 7º I b   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                  | 196.625,49    | 0,18%      | 1.757.846.296,75  | 0,01% | 7º I b   |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                       | 7.918,99      | 0,01%      | 4.036.357.184,84  | 0,00% | 7º III a |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                            | 813.893,75    | 0,73%      | 555.562.859,99    | 0,15% | 7º III a |
| BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                 | 20.372.022,29 | 18,33%     | 12.508.467.810,87 | 0,16% | 7º III a |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                       | 16.058.928,70 | 14,45%     | 15.416.999.740,59 | 0,10% | 7º III a |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP               | 330.596,16    | 0,30%      | 955.577.883,32    | 0,03% | 7º III a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                     | 3.595.505,53  | 3,23%      | 7.254.276.668,81  | 0,05% | 7º III a |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI       | 4.162.222,82  | 3,74%      | 3.555.599.377,38  | 0,12% | 7º III a |
| LF ITAÚ UNIBANCO 02/05/2029 IPCA + 6,31%                             | 790.405,75    | 0,71%      | 0,00              |       | 7º IV    |
| LF ITAÚ UNIBANCO 05/05/2028 IPCA + 6,22%                             | 790.104,09    | 0,71%      | 0,00              |       | 7º IV    |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES                                            | 1.735.878,77  | 1,56%      | 632.719.373,43    | 0,27% | 8º I     |
| BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES                                      | 2.954.207,77  | 2,66%      | 253.192.370,43    | 1,17% | 8º I     |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                                          | 1.856.394,28  | 1,67%      | 306.262.017,78    | 0,61% | 8º I     |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES                         | 878.747,24    | 0,79%      | 1.300.864.245,02  | 0,07% | 8º I     |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                                    | 3.258.543,92  | 2,93%      | 518.783.055,24    | 0,63% | 8º I     |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES                                            | 2.330.981,42  | 2,10%      | 257.278.195,81    | 0,91% | 8º I     |

## Investimentos

\$ 111.147.987,45

## Disponibilidades Financeiras

\$ 702.128,50

## Total Carteira

\$ 111.850.115,95

## Governança (Pró Gestão)

| Ativo                                              | Saldo Atual  | % Carteira | PL R\$           | % PL  | Lei    |
|----------------------------------------------------|--------------|------------|------------------|-------|--------|
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES                     | 1.264.569,59 | 1,14%      | 1.242.883.390,90 | 0,10% | 8º I   |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                             | 1.904.204,02 | 1,71%      | 1.465.357.143,91 | 0,13% | 8º I   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES | 776.778,23   | 0,70%      | 118.687.459,52   | 0,65% | 8º I   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES               | 336.813,50   | 0,30%      | 131.214.164,86   | 0,26% | 8º I   |
| SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES                       | 217.725,31   | 0,20%      | 61.873.274,12    | 0,35% | 8º I   |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I           | 439.127,84   | 0,40%      | 2.836.421.099,25 | 0,02% | 9º III |

Investimentos

 111.147.987,45

Disponibilidades Financeiras

 702.128,50

Total Carteira

 111.850.115,95

Governança (Pró Gestão)



| Título             | Data Compra | Marcacao              | Qtde | PU           | Valor \$     |
|--------------------|-------------|-----------------------|------|--------------|--------------|
| NTN-B - 15/08/2030 | 10/12/2021  | Curva - Taxa: 5,0200% | 29   | 4.616,015567 | 133.864,45   |
| NTN-B - 15/05/2035 | 10/09/2021  | Curva - Taxa: 4,6800% | 20   | 4.939,969358 | 98.799,39    |
| NTN-B - 15/08/2040 | 10/09/2021  | Curva - Taxa: 4,7500% | 49   | 5.001,01383  | 245.049,68   |
| NTN-B - 15/05/2045 | 26/03/2020  | Curva - Taxa: 4,5500% | 146  | 5.302,042262 | 774.098,17   |
| NTN-B - 15/05/2045 | 09/09/2021  | Curva - Taxa: 4,8600% | 351  | 5.110,294995 | 1.793.713,54 |
| NTN-B - 15/05/2045 | 10/09/2021  | Curva - Taxa: 4,7600% | 72   | 5.171,048282 | 372.315,48   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 29/03/2019  | Curva - Taxa: 4,4000% | 122  | 5.466,70501  | 666.938,01   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 31/03/2020  | Curva - Taxa: 4,4600% | 71   | 5.421,210667 | 384.905,96   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 02/04/2020  | Curva - Taxa: 4,5900% | 146  | 5.324,519978 | 777.379,92   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 06/04/2020  | Curva - Taxa: 4,6800% | 123  | 5.259,055584 | 646.863,84   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 08/04/2020  | Curva - Taxa: 4,6300% | 122  | 5.295,279824 | 646.024,14   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 09/04/2020  | Curva - Taxa: 4,7300% | 124  | 5.223,196412 | 647.676,36   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 15/05/2020  | Curva - Taxa: 4,6400% | 147  | 5.288,004554 | 777.336,67   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 23/11/2020  | Curva - Taxa: 4,3400% | 3    | 5.512,755645 | 16.538,27    |
| NTN-B - 15/08/2050 | 10/03/2021  | Curva - Taxa: 4,1500% | 19   | 5.662,35502  | 107.584,75   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 10/09/2021  | Curva - Taxa: 4,7800% | 69   | 5.187,693614 | 357.950,86   |
| NTN-B - 15/08/2050 | 15/08/2022  | Curva - Taxa: 5,8600% | 29   | 4.500,988937 | 130.528,68   |
| NTN-B - 15/05/2055 | 01/09/2021  | Curva - Taxa: 4,7600% | 359  | 5.335,91964  | 1.915.595,15 |
| NTN-B - 15/05/2055 | 10/09/2021  | Curva - Taxa: 4,8000% | 134  | 5.304,793305 | 710.842,30   |

## Investimentos

\$ 111.147.987,45

## Disponibilidades Financeiras

\$ 702.128,50

## Total Carteira

\$ 111.850.115,95

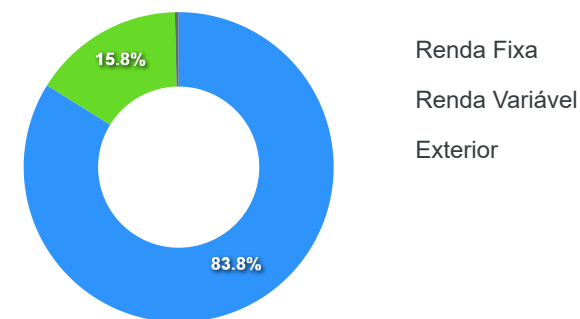
## Governança (Pró Gestão)

| Artigos                                          | Limite (%) | Utilizado | Livre                |
|--------------------------------------------------|------------|-----------|----------------------|
| 7º I a - Títulos TN SELIC                        | 100,00%    | 10,08%    | 11.204.005,60 89,92% |
| 7º I b - FI 100% Títulos TN                      | 100,00%    | 31,55%    | 35.068.411,88 68,45% |
| 7º III a - FI Referenciados RF                   | 60,00%     | 40,79%    | 45.341.088,24 19,21% |
| 7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de... | 20,00%     | 1,42%     | 1.580.509,84 18,58%  |
| 8º I - Fundos de Ações                           | 30,00%     | 15,76%    | 17.514.844,05 14,24% |
| 9º III - Ações - BDR Nível I                     | 10,00%     | 0,40%     | 439.127,84 9,60%     |

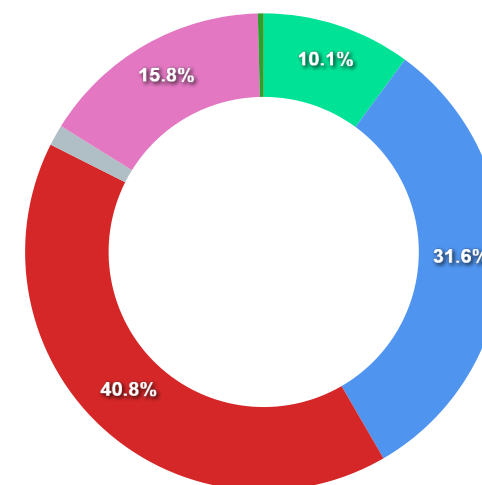
#### Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

#### Segmentos



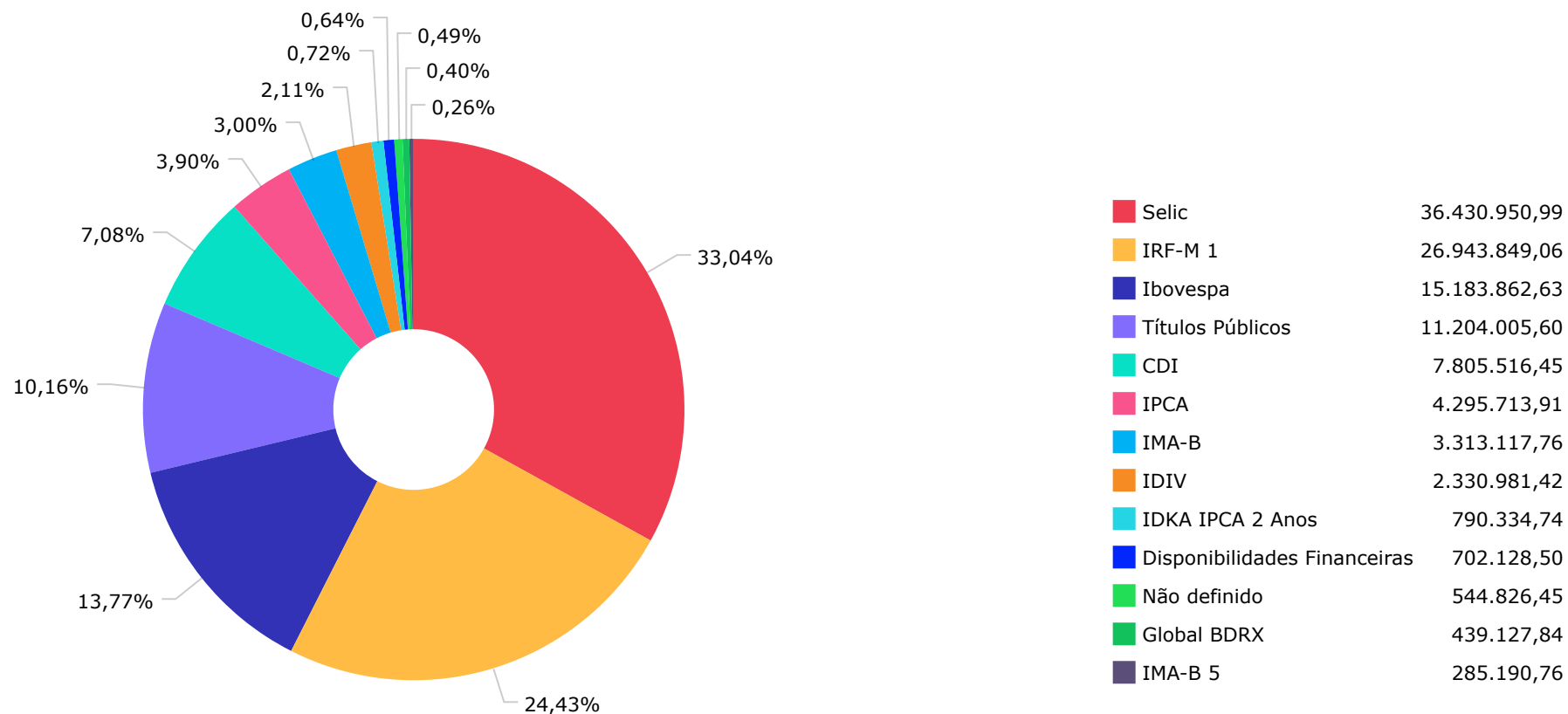
#### Artigos

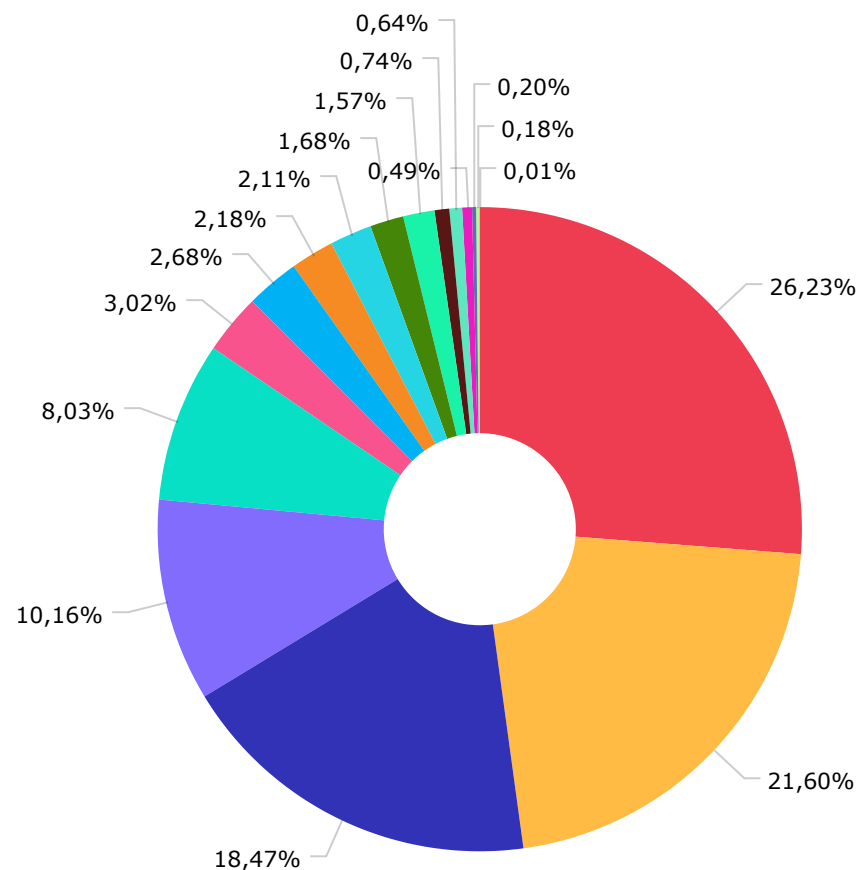


| Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo   | Superior | GAP Superior   | Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo   | Superior | GAP Superior  |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|----------------|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|---------------|
| 7º I a - Títulos TN SELIC         | 10,08% | 0,00%    | 12,00% | 100,00%  | 99.943.981,85  | 8º I - Fundos de Ações            | 15,76% | 0,00%    | 20,00% | 30,00%   | 15.829.552,19 |
| 7º I b - FI 100% Títulos TN       | 31,55% | 0,00%    | 24,00% | 100,00%  | 76.079.575,57  | 8º II - ETF de Ações              | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 30,00%   | 33.344.396,24 |
| 7º I c - ETF 100% Títulos TN      | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 100,00%  | 111.147.987,45 | 9º I - Renda Fixa - Dívida Ext... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 10,00%   | 11.114.798,75 |
| 7º II - Operações Compromissad... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 5.557.399,37   | 9º II - Constituídos no Brasil    | 0,00%  | 0,00%    | 2,00%  | 10,00%   | 11.114.798,75 |
| 7º III a - FI Referenciados RF    | 40,79% | 0,00%    | 33,00% | 60,00%   | 21.347.704,23  | 9º III - Ações - BDR Nível I      | 0,40%  | 0,00%    | 2,00%  | 10,00%   | 10.675.670,91 |
| 7º III b - FI de Índices Refer... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 60,00%   | 66.688.792,47  | 10º I - Fundos Multimercados      | 0,00%  | 0,00%    | 2,00%  | 10,00%   | 11.114.798,75 |
| 7º IV - Ativos Financeiros de ... | 1,42%  | 0,00%    | 1,00%  | 20,00%   | 20.649.087,65  | 10º II - Fundos em Participaçõ... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 5.557.399,37  |
| 7º V a - FIDC Cota Sênior         | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 5.557.399,37   | 10º III - Fundos de Ações - Me... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 5.557.399,37  |
| 7º V b - Fundos de RF - Crédit... | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 5,00%    | 5.557.399,37   | 11º - Fundos Imobiliários         | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 5,00%    | 5.557.399,37  |
| 7º V c - Fundos de Debentures ... | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 5,00%    | 5.557.399,37   | 12º - Empréstimos Consignados     | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 5.557.399,37  |

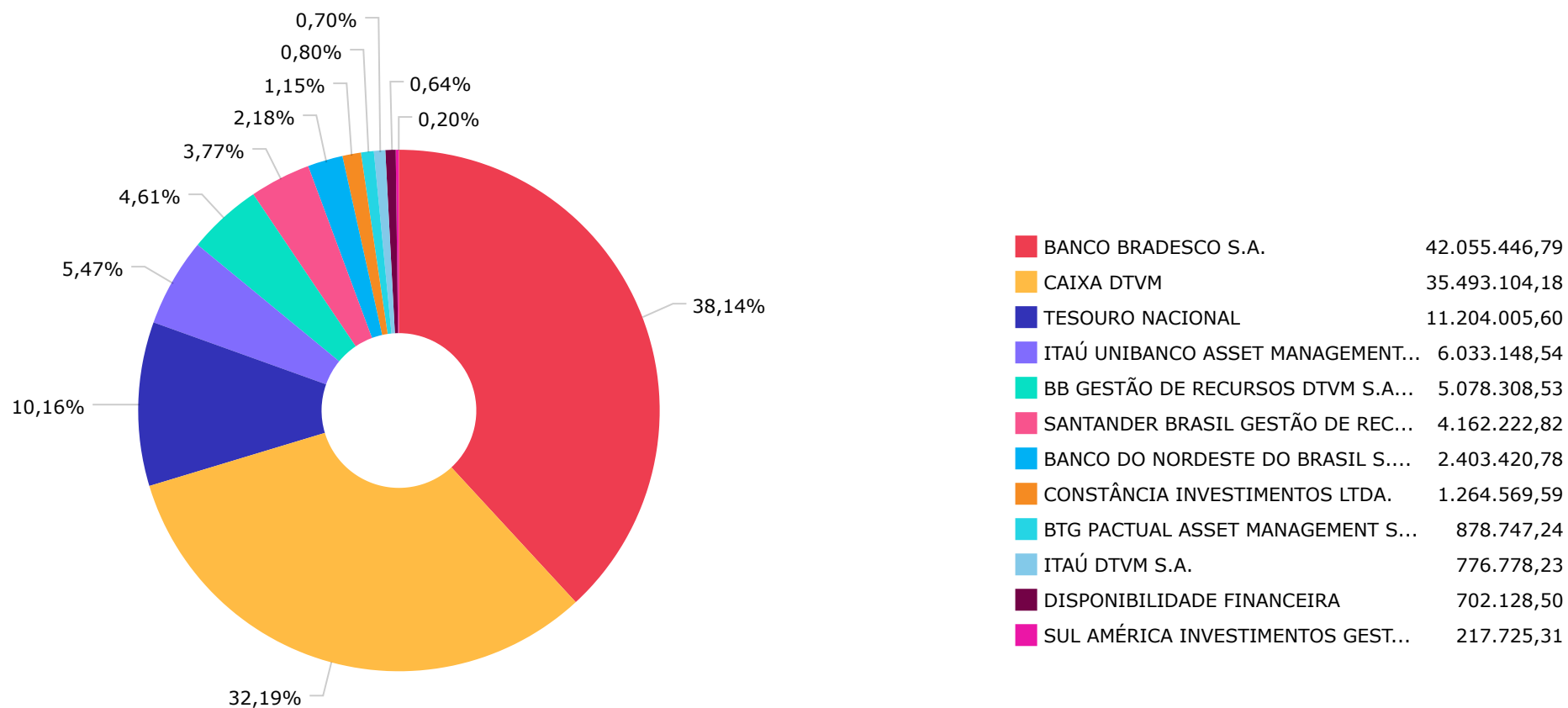
|                                                                                | Mês   | Ano    | 3M    | 6M    | 12M   | 24M    | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|--------------------------------------------------------------------------------|-------|--------|-------|-------|-------|--------|-----------|--------------------|
| <b>NÃO DEFINIDO - BENCHMARK</b>                                                |       |        |       |       |       |        |           |                    |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI... | 0,89  |        | 2,01  |       |       |        | 0,85      | 1,80               |
| <b>CDI - BENCHMARK</b>                                                         |       |        |       |       |       |        |           |                    |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                               | 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  | 0,02      | 0,04               |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                                 | 0,95  | 8,79   | 2,67  | 5,24  | 10,77 | 25,47  | 0,06      | 0,13               |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                                 | 0,85  | 8,10   | 2,40  | 4,75  | 9,90  | 23,39  | 0,03      | 0,06               |
| <b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>                                                 |       |        |       |       |       |        |           |                    |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                                       | 5,92  | 48,88  | 6,17  | 28,45 | 62,54 | 89,30  | 6,60      | 13,89              |
| <b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>                                                    |       |        |       |       |       |        |           |                    |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                                         | -1,60 | -3,33  | 1,61  | 3,01  | 14,64 | 11,79  |           |                    |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES                                                      | -2,34 | 8,56   | 4,11  | 8,12  | 31,93 | 12,68  | 5,98      | 12,59              |
| BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES                                                | -1,49 | -3,03  | 1,34  | 2,75  | 14,77 | 9,14   | 4,54      | 9,56               |
| SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES                                                   | -1,63 | -3,42  | 1,64  | 3,03  | 14,64 | 11,92  | 4,66      | 9,81               |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES                                                 | -1,63 | -4,37  | 0,71  | 1,71  | 12,61 | 5,35   | 4,49      | 9,45               |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES                             | -1,43 | -5,47  | 1,26  | 1,87  | 10,99 | 1,39   | 4,13      | 8,69               |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                                                    | -1,40 | -5,76  | 0,62  | 1,94  | 10,96 | -2,67  | 4,74      | 9,98               |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                                              | -0,60 | -8,21  | 1,69  | 1,49  | 8,21  | -3,28  | 4,82      | 10,15              |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES                                   | -1,51 | -7,97  | -1,25 | -0,23 | 7,31  | -4,30  | 4,62      | 9,73               |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                                           | -1,30 | -9,95  | -2,34 | -2,10 | 5,66  | -7,08  | 5,41      | 11,39              |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                                           | -2,07 | -11,76 | -0,74 | -0,32 | 3,89  | -19,96 | 4,16      | 8,75               |
| <b>IDIV - BENCHMARK</b>                                                        |       |        |       |       |       |        |           |                    |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES                                                      | -1,72 | 2,45   | 4,09  | 7,11  | 21,24 | 28,86  |           |                    |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES                                                      | -1,79 | 1,45   | 3,72  | 6,36  | 19,50 | 25,66  | 4,45      | 9,38               |

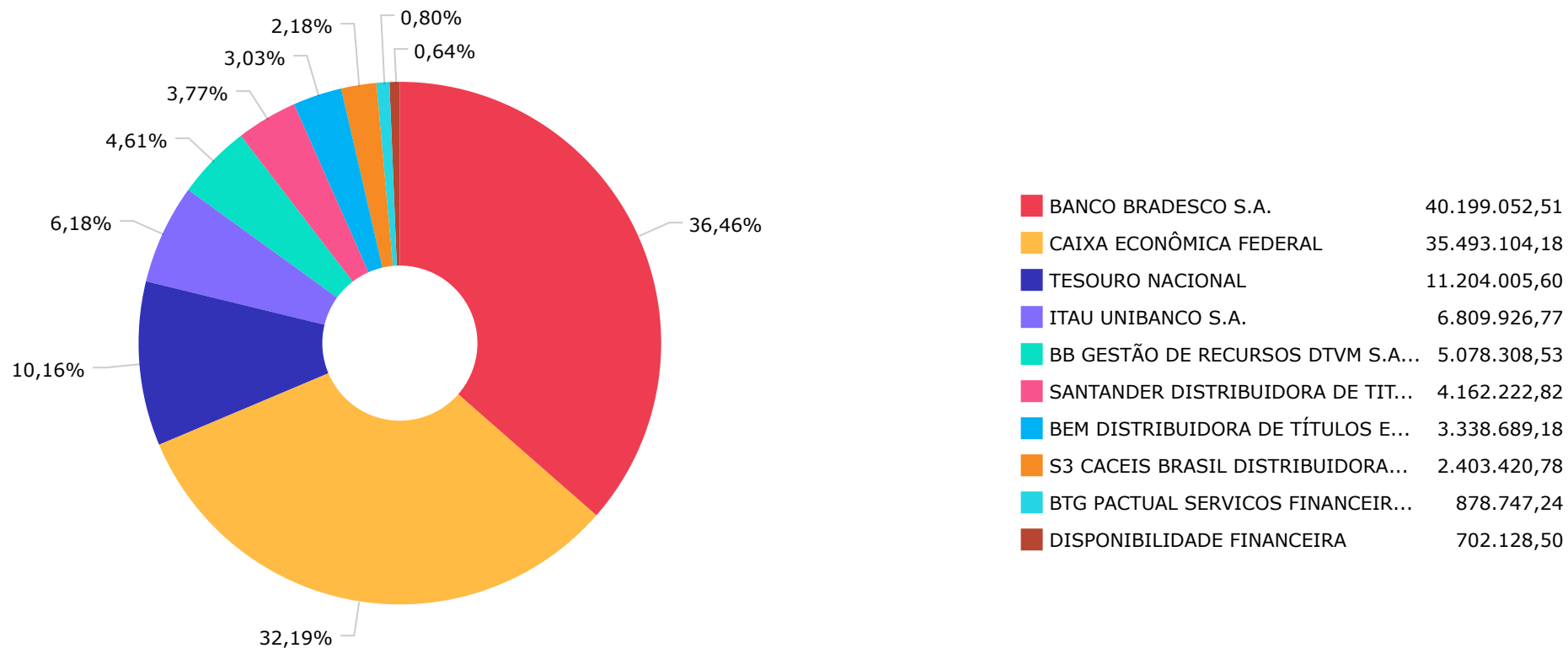
|                                                               | Mês          | Ano         | 3M           | 6M          | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---------------------------------------------------------------|--------------|-------------|--------------|-------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK</b>                           | <b>0,81</b>  | <b>5,86</b> | <b>1,81</b>  | <b>3,85</b> | <b>9,37</b>  | <b>19,24</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 0,76         | 5,52        | 1,76         | 3,75        | 8,86         | 18,70        | 0,94      | 1,97               |
| <b>IMA-B - BENCHMARK</b>                                      | <b>-0,65</b> | <b>0,16</b> | <b>-0,80</b> | <b>1,63</b> | <b>5,62</b>  | <b>15,10</b> |           |                    |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA                                  | -0,56        | 0,41        | -0,56        | 1,83        | 5,94         | 15,43        | 1,78      | 3,74               |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP        | -0,64        | 0,17        | -0,58        | 1,70        | 5,69         | 14,85        | 1,85      | 3,89               |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | -0,68        | -0,06       | -0,87        | 1,48        | 5,35         | 14,56        | 1,89      | 3,98               |
| <b>IMA-B 5 - BENCHMARK</b>                                    | <b>0,74</b>  | <b>6,08</b> | <b>1,74</b>  | <b>4,16</b> | <b>9,57</b>  | <b>19,66</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 0,72         | 5,89        | 1,69         | 4,04        | 9,33         | 19,24        | 0,88      | 1,86               |
| <b>IPCA - BENCHMARK</b>                                       | <b>0,56</b>  | <b>3,88</b> | <b>0,98</b>  | <b>2,05</b> | <b>4,76</b>  | <b>9,81</b>  |           |                    |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,75         | 7,45        | 2,42         | 4,63        | 9,66         | 24,36        | 0,25      | 0,54               |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA           | 0,82         | 5,04        | 2,17         | 3,63        | 9,50         | 19,98        | 0,44      | 0,92               |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,66         | 4,59        | 1,65         | 3,61        | 9,09         | 18,47        | 1,04      | 2,19               |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                | 0,86         | 5,49        | 2,07         | 3,96        | 8,29         | 21,29        | 0,41      | 0,86               |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                     | 0,18         | 4,22        | 1,08         | 3,04        | 7,70         | 20,55        | 0,98      | 2,07               |
| <b>IRF-M 1 - BENCHMARK</b>                                    | <b>0,84</b>  | <b>8,08</b> | <b>2,45</b>  | <b>4,88</b> | <b>10,15</b> | <b>25,01</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 0,83         | 7,99        | 2,40         | 4,77        | 10,00        | 24,59        | 0,14      | 0,30               |
| <b>SELIC - BENCHMARK</b>                                      | <b>0,93</b>  | <b>8,99</b> | <b>2,65</b>  | <b>5,27</b> | <b>10,98</b> | <b>25,87</b> |           |                    |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                | 0,93         | 9,68        | 2,75         | 5,56        | 11,80        | 27,41        | 0,02      | 0,05               |
| BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI          | 0,91         | 8,79        | 2,60         | 5,16        | 10,71        | 25,24        | 0,02      | 0,03               |





|                                               |               |
|-----------------------------------------------|---------------|
| Renda Fixa Indexados                          | 28.929.071,54 |
| Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento | 23.816.657,05 |
| Renda Fixa Duração Baixa Soberano             | 20.372.022,29 |
| Títulos Públicos                              | 11.204.005,60 |
| Ações Livre                                   | 8.858.784,34  |
| Renda Fixa Duração Livre Soberano             | 3.325.063,78  |
| Ações Indexados                               | 2.954.207,77  |
| Renda Fixa Duração Alta Soberano              | 2.403.420,78  |
| Ações Dividendos                              | 2.330.981,42  |
| Ações Índice Ativo                            | 1.856.394,28  |
| Ações Sustentabilidade/Governança             | 1.735.878,77  |
| Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento  | 813.893,75    |
| Disponibilidades Financeiras                  | 702.128,50    |
| Não classificado                              | 544.826,45    |
| Ações Valor/Crescimento                       | 217.725,31    |
| Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre        | 196.625,49    |
| Renda Fixa Simples                            | 7.918,99      |



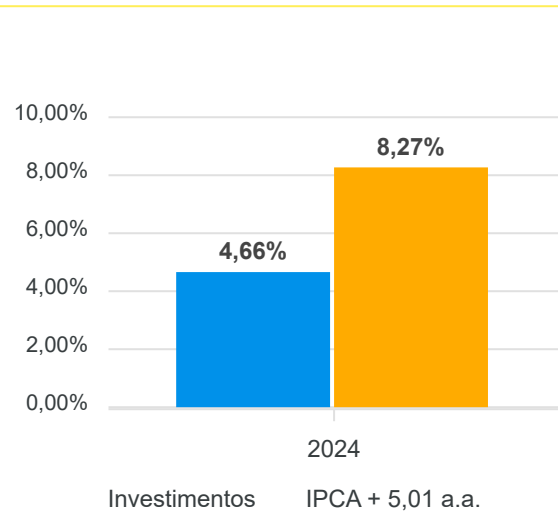


| Mês       | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual    | Retorno \$   | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|--------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| 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%       |
| Outubro   | 109.582.741,55 | 39.818.948,33 | 38.684.253,94 | 111.147.987,45 | 430.551,51   | 4.794.437,84         | 0,39% ▲   | 4,66%               | 1,01%  | 8,27%            | 56,35%                     | 0,91%       |

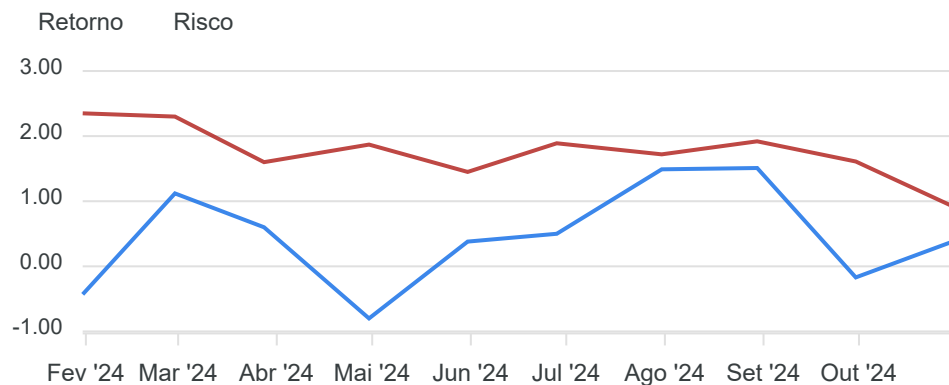
Retorno Acumulado (Períodos)

| 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%  |

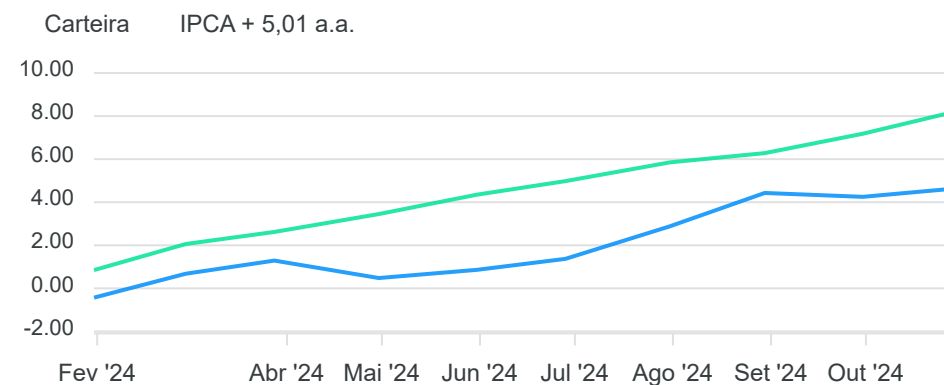
Gráfico Retorno e Meta Acumulado



**Gráfico Risco x Retorno**

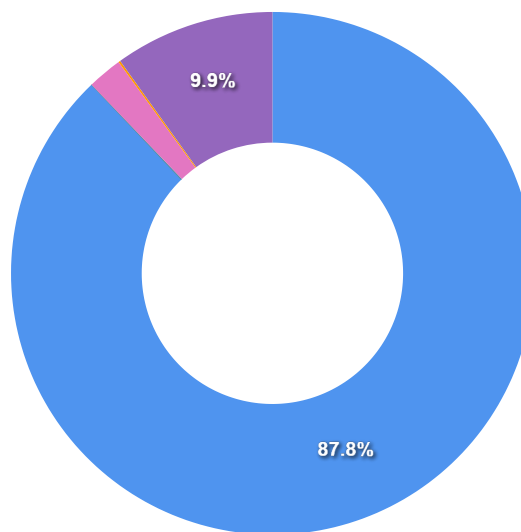


**Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade**



**Liquidez - 31/10/2024**

| Disponibilidade | Valor         | %     |
|-----------------|---------------|-------|
| Até D+30        | 98.242.034,61 | 87,83 |
| Até D+180       | 0,00          | 0,00  |
| Até D+360       | 0,00          | 0,00  |
| Até D+720       | 0,00          | 0,00  |
| Até D+1800      | 2.404.075,74  | 2,15  |
| Até D+3600      | 133.864,45    | 0,12  |
| Acima D+3600    | 11.070.141,14 | 9,90  |
| Indeterminado   | 0,00          | 0,00  |



| RENDA FIXA                                                                   | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual   | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|------------------------------------------------------------------------------|----------------|---------------|---------------|---------------|------------|-----------|-------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS                                                             | 11.100.685,60  | 0,00          | 0,00          | 11.204.005,60 | 103.320,00 | 0,93% ▲   | -           |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                | 1.951.515,95   | 0,00          | 0,00          | 1.966.118,42  | 14.602,47  | 0,75% ▲   | 0,25%       |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                       | 560.652,15     | 0,00          | 559.253,94    | 0,00          | -1.398,21  | -0,25% ▼  | 1,88%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                | 818.153,49     | 0,00          | 0,00          | 823.565,90    | 5.412,41   | 0,66% ▲   | 1,04%       |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA                                                 | 2.416.932,13   | 0,00          | 0,00          | 2.403.420,78  | -13.511,35 | -0,56% ▼  | 1,78%       |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                                    | 16.816.874,57  | 0,00          | 16.000.000,00 | 813.893,75    | -2.980,82  | -0,02% ▼  | 0,98%       |
| BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                         | 20.188.238,30  | 0,00          | 0,00          | 20.372.022,29 | 183.783,99 | 0,91% ▲   | 0,02%       |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                               | 1.486.833,33   | 0,00          | 1.000.000,00  | 495.510,35    | 8.677,02   | 0,58% ▲   | 0,41%       |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                  | 784.382,07     | 0,00          | 0,00          | 790.334,74    | 5.952,67   | 0,76% ▲   | 0,94%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                       | 1.777.354,67   | 0,00          | 1.500.000,00  | 285.190,76    | 7.836,09   | 0,44% ▲   | 0,88%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                         | 13.593.385,12  | 0,00          | 13.000.000,00 | 579.100,82    | -14.284,30 | -0,11% ▼  | 1,89%       |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                          | 8.292.643,87   | 18.500.000,00 | 0,00          | 26.943.849,06 | 151.205,19 | 0,56% ▲   | 0,14%       |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                               | 39.492,87      | 0,00          | 0,00          | 39.869,11     | 376,24     | 0,95% ▲   | 0,06%       |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP                       | 1.333.399,16   | 0,00          | 1.000.000,00  | 330.596,16    | -2.803,00  | -0,21% ▼  | 1,85%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                          | 3.184.477,32   | 0,00          | 3.000.000,00  | 196.625,49    | 12.148,17  | 0,38% ▲   | 0,44%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                             | 574.615,91     | 3.000.000,00  | 0,00          | 3.595.505,53  | 20.889,62  | 0,58% ▲   | 0,02%       |
| LF ITAÚ UNIBANCO 02/05/2029 IPCA + 6,31%                                     | 783.124,68     | 0,00          | 0,00          | 790.405,75    | 7.281,07   | 0,93% ▲   | -           |
| LF ITAÚ UNIBANCO 05/05/2028 IPCA + 6,22%                                     | 782.876,70     | 0,00          | 0,00          | 790.104,09    | 7.227,39   | 0,92% ▲   | -           |
| SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI               | 2.983.701,79   | 1.767.640,44  | 625.000,00    | 4.162.222,82  | 35.880,59  | 0,76% ▲   | 0,03%       |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                               | 0,00           | 7.887,30      | 0,00          | 7.918,99      | 31,69      | 0,40% ▲   | 0,03%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00           | 543.420,59    | 0,00          | 544.826,45    | 1.405,86   | 0,26% ▲   | 0,85%       |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                               | 0,00           | 16.000.000,00 | 0,00          | 16.058.928,70 | 58.928,70  | 0,37% ▲   | 0,02%       |
|                                                                              | 89.469.339,68  | 39.818.948,33 | 36.684.253,94 | 93.194.015,56 | 589.981,49 | 0,64%     | 0,16%       |

| RENTA VARIÁVEL                                     | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$  | Retorno % | Risco - VaR |
|----------------------------------------------------|----------------|------------|----------|---------------|-------------|-----------|-------------|
| BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES                           | 1.762.104,81   | 0,00       | 0,00     | 1.735.878,77  | -26.226,04  | -1,49% ▼  | 4,54%       |
| BRADERCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES                     | 3.003.054,43   | 0,00       | 0,00     | 2.954.207,77  | -48.846,66  | -1,63% ▼  | 4,66%       |
| BRADERCO SELECTION FIAÇÕES                         | 1.867.628,36   | 0,00       | 0,00     | 1.856.394,28  | -11.234,08  | -0,60% ▼  | 4,82%       |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES       | 890.323,97     | 0,00       | 0,00     | 878.747,24    | -11.576,73  | -1,30% ▼  | 5,41%       |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                  | 3.308.557,00   | 0,00       | 0,00     | 3.258.543,92  | -50.013,08  | -1,51% ▼  | 4,62%       |
| CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES                           | 2.373.531,55   | 0,00       | 0,00     | 2.330.981,42  | -42.550,13  | -1,79% ▼  | 4,45%       |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES                      | 1.282.872,49   | 0,00       | 0,00     | 1.264.569,59  | -18.302,90  | -1,43% ▼  | 4,13%       |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                             | 1.949.905,87   | 0,00       | 0,00     | 1.904.204,02  | -45.701,85  | -2,34% ▼  | 5,98%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES | 787.777,07     | 0,00       | 0,00     | 776.778,23    | -10.998,84  | -1,40% ▼  | 4,74%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES               | 343.944,08     | 0,00       | 0,00     | 336.813,50    | -7.130,58   | -2,07% ▼  | 4,16%       |
| SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES                        | 221.328,38     | 0,00       | 0,00     | 217.725,31    | -3.603,07   | -1,63% ▼  | 4,49%       |
| -                                                  | 17.791.028,01  | 0,00       | 0,00     | 17.514.844,05 | -276.183,96 | -1,55%    | 4,76%       |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR                | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates     | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|------------------------------------------|----------------|------------|--------------|-------------|------------|-----------|-------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 2.322.373,86   | 0,00       | 2.000.000,00 | 439.127,84  | 116.753,98 | 5,03% ▲   | 6,60%       |
|                                          | 2.322.373,86   | 0,00       | 2.000.000,00 | 439.127,84  | 116.753,98 | 5,03%     | 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 à política fiscal e à 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

