

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.453.243,73	3,80%	8.329.801.460,71	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	500.331,98	0,43%	483.025.270,07	0,10%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	19.399.279,24	16,55%	4.436.237.468,68	0,44%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.347.915,85	13,10%	4.168.680.215,13	0,37%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.275.075,79	8,77%	6.913.810.528,18	0,15%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.216.715,23	8,72%	3.720.203.081,78	0,27%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.158.756,86	9,52%	8.159.464.453,76	0,14%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.041.265,06	5,16%	11.229.374.861,63	0,05%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	8.571.274,01	7,31%	1.856.541.125,92	0,46%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	5.504.704,30	4,70%	1.594.793.152,04	0,35%	7º I b
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	7.243.990,21	6,18%	39.704.532.570,82	0,02%	7º I b
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	6.170.736,84	5,27%	3.347.231.343,13	0,18%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	196.468,84	0,17%	3.861.447.255,05	0,01%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.526.386,45	4,72%	20.065.228.623,01	0,03%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.344.961,23	2,00%	14.753.446.791,76	0,02%	7º III a
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	155.576,38	0,13%	28.932.663,18	0,54%	7º V a
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.191.199,57	1,02%	308.317.813,44	0,39%	8º I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	527.823,74	0,45%	1.096.030.531,90	0,05%	8º I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	759.662,26	0,65%	228.356.187,58	0,33%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	992.114,34	0,85%	139.753.891,10	0,71%	8º I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	334.085,25	0,29%	172.057.049,30	0,19%	8º I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	272.570,52	0,23%	56.874.171,21	0,48%	11º

Investimentos

\$ 117.184.137,68

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 117.184.137,68

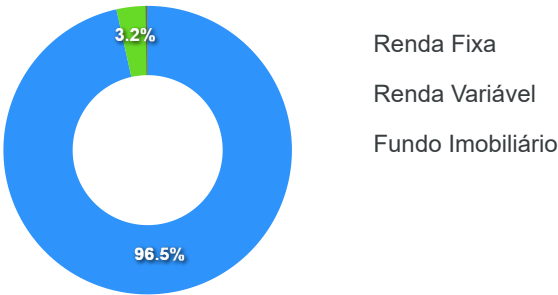
Governança (Pró Gestão)

Artigos	Limite (%)	Utilizado			Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	89,50%	104.883.289,10	10,50%	12.300.848,58
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	6,88%	8.067.816,52	53,12%	62.242.666,09
7º V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	0,13%	155.576,38	4,87%	5.703.630,50
8º I - Fundos de Ações	30,00%	3,25%	3.804.885,16	26,75%	31.350.356,14
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,23%	272.570,52	4,77%	5.586.636,36

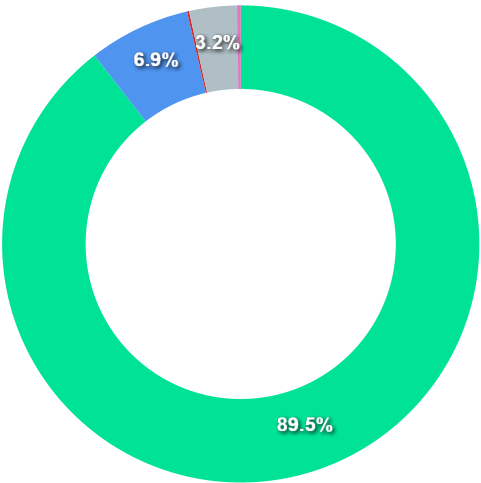
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



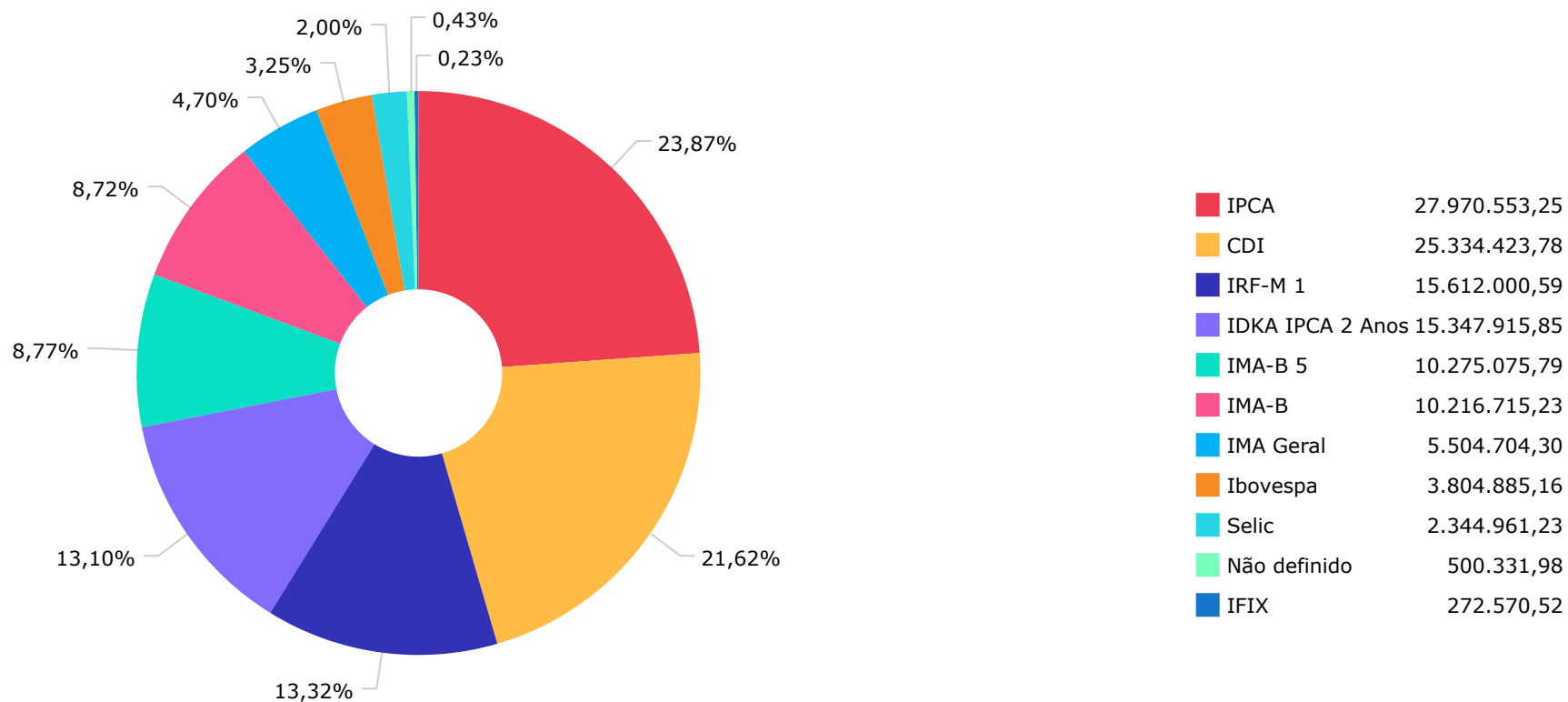
Artigos

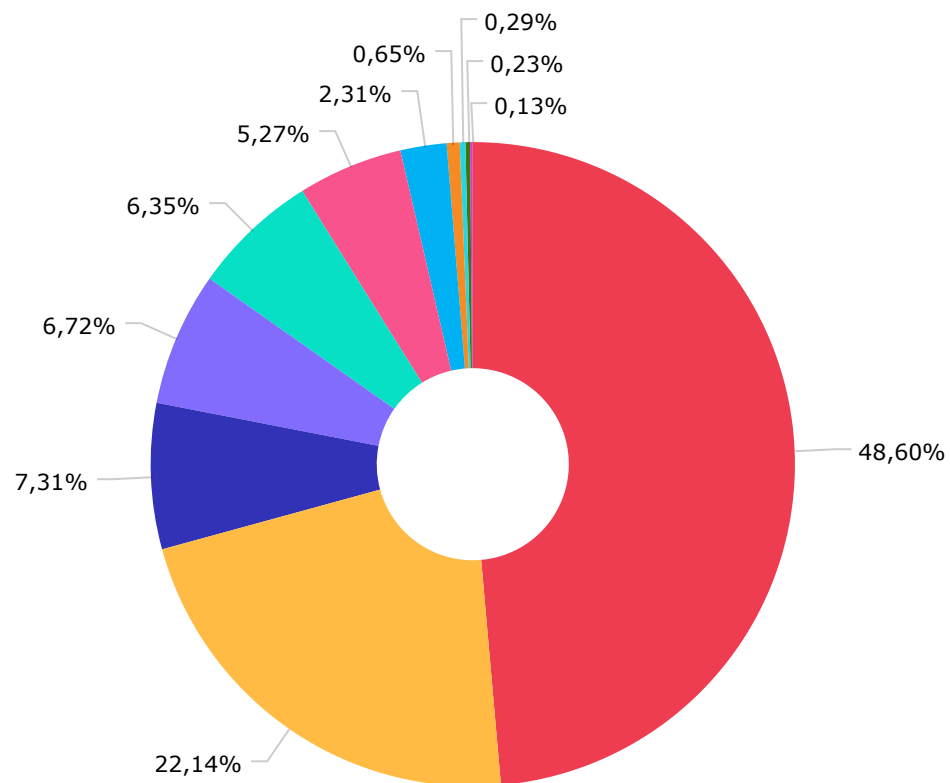


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	117.184.137,68	8º I - Fundos de Ações	3,25%	0,00%	4,00%	30,00%	31.350.356,14
7º I b - FI 100% Títulos TN	89,50%	0,00%	80,00%	100,00%	12.300.848,58	9º III - Ações - BDR Nível I	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	11.718.413,77
7º III a - FI Referenciados RF	6,88%	0,00%	7,00%	60,00%	62.242.666,09	10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	11.718.413,77
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,13%	0,00%	1,00%	5,00%	5.703.630,50	11º - Fundos Imobiliários	0,23%	0,00%	1,00%	5,00%	5.586.636,36
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.859.206,88	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	23.436.827,54
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.859.206,88						

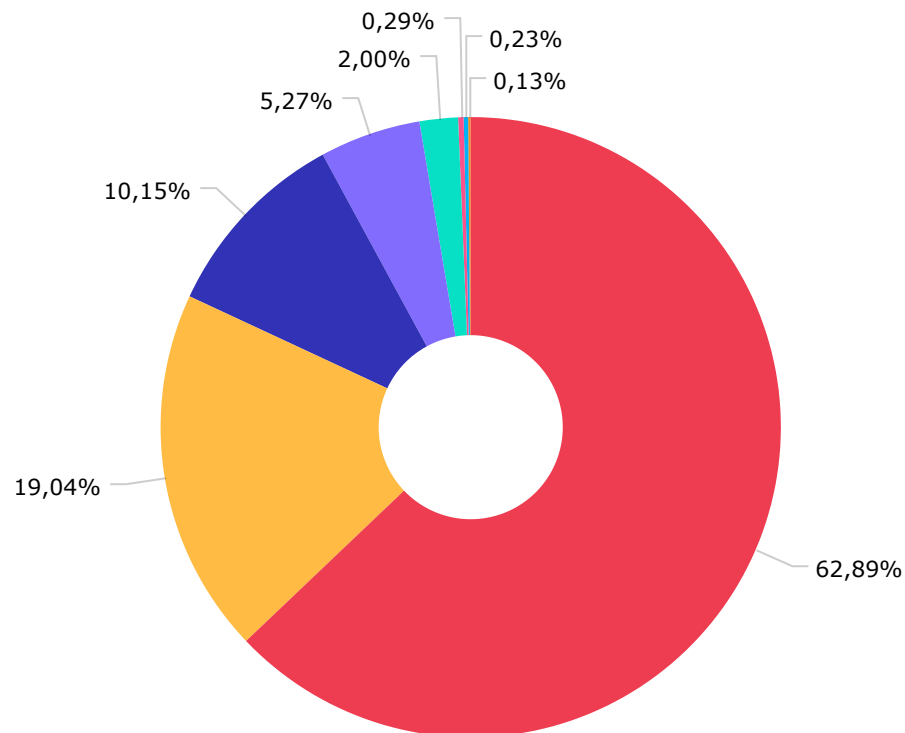
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,32						1,12	2,36
CDI - BENCHMARK								
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,84	8,11	2,73	5,33	11,17	26,07	0,01	0,02
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	0,85	8,03	2,67	5,26	11,04	25,96	0,01	0,02
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,83	7,94	2,62	5,20	10,96	25,80	0,01	0,02
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83	7,77	2,64	5,08	10,77	25,55	0,02	0,04
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		
IBOVESPA - BENCHMARK								
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	-4,69	-4,90	3,31	-1,79	7,76	6,83	5,41	11,39
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	-5,77	-6,61	9,59	-4,88	7,25	-7,72	8,90	18,75
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-2,49	-4,99	4,82	0,49	7,22	12,41	5,33	11,22
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-3,14	-7,65	3,89	-0,21	5,18	7,22	5,73	12,07
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-3,21	-9,89	5,97	-4,72	-1,66	-12,59	5,61	11,81
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK								
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 GERAL - BENCHMARK								
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,39	5,16	1,87	3,09	8,23	20,61	0,96	2,03
IMA-B - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28		
	-0,69	0,63	1,88	0,50	5,37	16,71	1,87	3,93

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
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 RESP LIMITADA FIF CIC 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
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
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80	6,98	2,47	4,44	9,98	24,49	0,14	0,30
SELIC - BENCHMARK	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98		
BRADESCO 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		
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-3,05	16,06	-7,56	-25,70	-10,17	-60,15	9,35	19,70

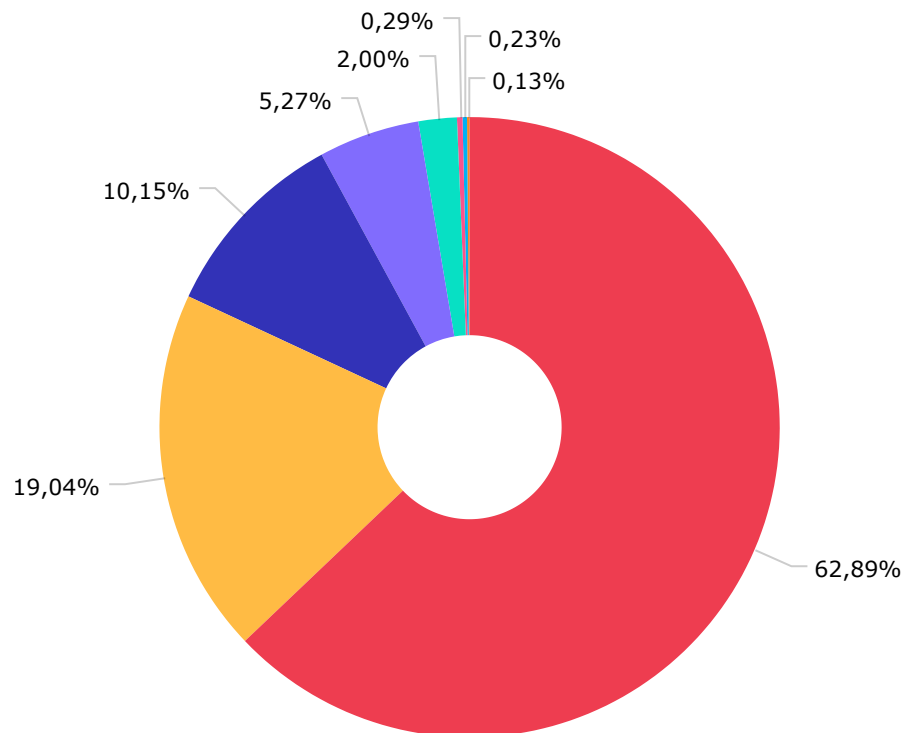




Renda Fixa Indexados	56.956.411,76
Renda Fixa Duração Livre Soberano	25.940.876,28
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	8.571.274,01
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	7.871.347,68
Renda Fixa Simples	7.440.459,05
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	6.170.736,84
Ações Livre	2.711.137,65
Fundos de Mono Ação	759.662,26
Ações Índice Ativo	334.085,25
FII Renda Gestão Ativa	272.570,52
FIDC Outros	155.576,38



CAIXA DTVM	73.699.002,27
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT...	22.312.082,86
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	11.895.122,33
CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ...	6.170.736,84
BANCO BRADESCO S.A.	2.344.961,23
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	334.085,25
ZION GESTÃO DE RECURSOS LTDA	272.570,52
PETRA CAPITAL GESTÃO DE INVEST...	155.576,38



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	73.699.002,27
ITAU UNIBANCO S.A.	22.312.082,86
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	11.895.122,33
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	6.170.736,84
BANCO BRADESCO S.A.	2.344.961,23
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	334.085,25
PLANNER TRUSTEE DTVM LTDA.	272.570,52
FINAXIS CORRETORA DE TÍTULOS E...	155.576,38

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	105.123.835,70	0,00	0,00	105.639.631,88	515.796,18	515.796,18	0,49% ▲	0,49%	0,86%	0,86%	56,98%	0,85%
Fevereiro	105.639.631,88	7.257.651,08	6.277.539,91	107.455.037,56	835.294,51	1.351.090,69	0,78% ▲	1,28%	1,21%	2,08%	61,54%	0,78%
Março	107.455.037,56	550.000,00	0,00	108.712.083,12	707.045,56	2.058.136,25	0,65% ▲	1,94%	0,56%	2,65%	73,21%	0,64%
Abril	108.712.083,12	1.505.729,19	2.611.056,30	107.321.386,26	-285.369,75	1.772.766,50	-0,26% ▼	1,67%	0,82%	3,50%	47,71%	1,02%
Mai	107.321.386,26	3.389.602,66	25.000,00	111.459.384,53	773.395,61	2.546.162,11	0,70% ▲	2,38%	0,88%	4,41%	53,97%	0,76%
Junho	111.459.384,53	1.000.000,00	0,00	112.775.572,95	316.188,42	2.862.350,53	0,28% ▲	2,67%	0,61%	5,04%	52,98%	1,01%
Julho	112.775.572,95	0,00	0,00	114.022.964,47	1.247.391,52	4.109.742,05	1,11% ▲	3,81%	0,84%	5,93%	64,25%	0,89%
Agosto	114.022.964,47	1.690.000,00	784.574,61	115.869.366,47	940.976,61	5.050.718,66	0,82% ▲	4,66%	0,42%	6,37%	73,16%	1,03%
Setembro	115.869.366,47	913.334,35	0,00	117.184.137,68	401.436,86	5.452.155,52	0,34% ▲	5,02%	0,86%	7,28%	68,96%	0,79%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	2.058.136,25	1,94%	2,65%
2º Trim	804.214,28	0,72%	2,33%
1º Sem	2.862.350,53	2,67%	5,04%
3º Trim	2.589.804,99	2,28%	2,13%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

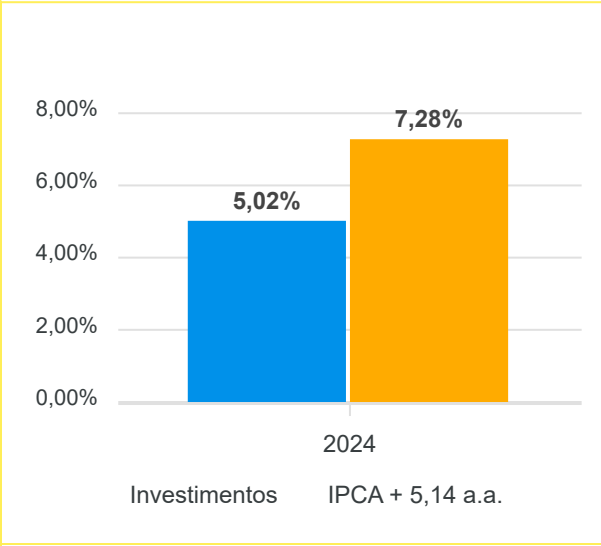
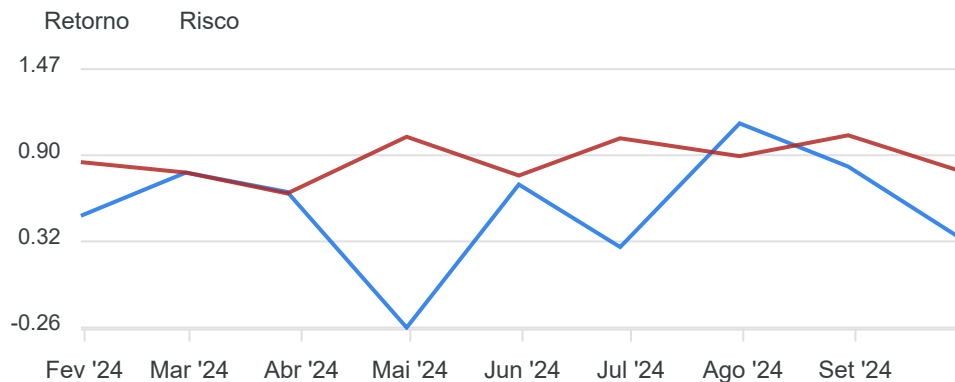
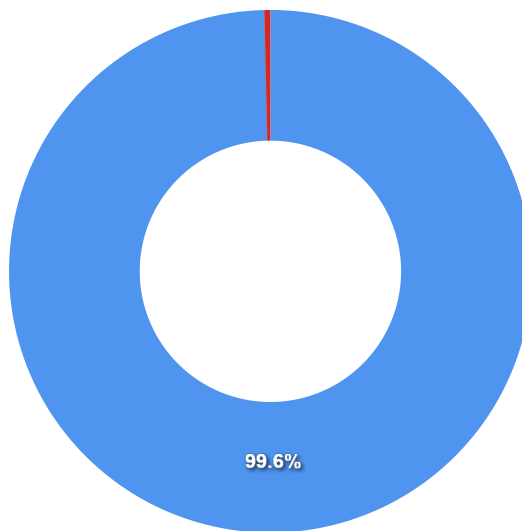


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 30/09/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	116.755.990,78	99,63
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	428.146,90	0,37



RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB FLUXO FIC RENTA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	195.001,17	0,00	0,00	196.468,84	1.467,67	0,75% ▲	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.417.938,37	0,00	0,00	4.453.243,73	35.305,36	0,80% ▲	0,14%
BB PERFIL FIC RENTA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.480.256,02	0,00	0,00	5.526.386,45	46.130,43	0,84% ▲	0,01%
BRANESCO PREMIUM FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI	2.324.390,40	0,00	0,00	2.344.961,23	20.570,83	0,88% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENTA FIXA	498.752,78	0,00	0,00	500.331,98	1.579,20	0,32% ▲	1,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIXA	19.298.051,18	0,00	0,00	19.399.279,24	101.228,06	0,52% ▲	0,56%
CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	15.287.291,96	0,00	0,00	15.347.915,85	60.623,89	0,40% ▲	0,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	10.235.987,26	0,00	0,00	10.275.075,79	39.088,53	0,38% ▲	0,96%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	10.287.496,30	0,00	0,00	10.216.715,23	-70.781,07	-0,69% ▼	1,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	11.069.464,23	0,00	0,00	11.158.756,86	89.292,63	0,81% ▲	0,14%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	5.511.486,41	483.334,35	0,00	6.041.265,06	46.444,30	0,77% ▲	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENTA FIXA	8.517.354,98	0,00	0,00	8.571.274,01	53.919,03	0,63% ▲	0,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENTA FIXA	5.483.523,84	0,00	0,00	5.504.704,30	21.180,46	0,39% ▲	0,96%
ITAÚ SOBERANO FIC RENTA FIXA SIMPLES	6.757.872,11	430.000,00	0,00	7.243.990,21	56.118,10	0,78% ▲	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	156.196,63	0,00	0,00	155.576,38	-620,25	-0,40% ▼	-
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENTA FIXA	6.118.880,72	0,00	0,00	6.170.736,84	51.856,12	0,85% ▲	0,01%
	111.639.944,36	913.334,35	0,00	113.106.682,00	553.403,29	0,49%	0,59%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.221.611,03	0,00	0,00	1.191.199,57	-30.411,46	-2,49% ▼	5,33%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	544.959,28	0,00	0,00	527.823,74	-17.135,54	-3,14% ▼	5,73%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	806.188,73	0,00	0,00	759.662,26	-46.526,47	-5,77% ▼	8,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.024.988,26	0,00	0,00	992.114,34	-32.873,92	-3,21% ▼	5,61%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	350.532,89	0,00	0,00	334.085,25	-16.447,64	-4,69% ▼	5,41%
-	3.948.280,19	0,00	0,00	3.804.885,16	-143.395,03	-3,63%	6,18%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	281.141,92	0,00	0,00	272.570,52	-8.571,40	-3,05% ▼	9,35%
-	281.141,92	0,00	0,00	272.570,52	-8.571,40	-3,05%	9,35%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENTA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	191.840,90	200.000,00	200.000,00	196.468,84	4.627,94	1,18% ▲
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENTA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.345.985,18	0,00	0,00	4.453.243,73	107.258,55	2,47% ▲
BB PERFIL FIC RENTA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.183.192,81	200.000,00	0,00	5.526.386,45	143.193,64	2,66% ▲
BRANCO PREMIUM FI RENTA FIXA REFERENCIADO DI	2.063.850,69	220.000,00	0,00	2.344.961,23	61.110,54	2,68% ▲
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	575.875,51	0,00	584.574,61	0,00	8.699,10	1,51% ▲
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENTA FIXA	0,00	500.000,00	0,00	500.331,98	331,98	0,07% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENTA FIXA	18.985.298,30	0,00	0,00	19.399.279,24	413.980,94	2,18% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	15.087.861,20	0,00	0,00	15.347.915,85	260.054,65	1,72% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	10.086.838,32	0,00	0,00	10.275.075,79	188.237,47	1,87% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	10.028.502,61	0,00	0,00	10.216.715,23	188.212,62	1,88% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA	10.689.241,08	200.000,00	0,00	11.158.756,86	269.515,78	2,48% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIXA LP	5.414.700,52	483.334,35	0,00	6.041.265,06	143.230,19	2,43% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENTA FIXA	8.384.161,85	0,00	0,00	8.571.274,01	187.112,16	2,23% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENTA FIXA	5.403.559,61	0,00	0,00	5.504.704,30	101.144,69	1,87% ▲
ITAÚ SOBERANO FIC RENTA FIXA SIMPLES	6.491.491,03	580.000,00	0,00	7.243.990,21	172.499,18	2,44% ▲
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	157.598,54	0,00	0,00	155.576,38	-2.022,16	-1,28% ▼
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENTA FIXA	5.793.367,79	220.000,00	0,00	6.170.736,84	157.369,05	2,62% ▲
	108.883.365,94	2.603.334,35	784.574,61	113.106.682,00	2.404.556,32	2,17%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.136.463,91	0,00	0,00	1.191.199,57	54.735,66	4,82% ▲
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	508.064,08	0,00	0,00	527.823,74	19.759,66	3,89% ▲
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	693.187,37	0,00	0,00	759.662,26	66.474,89	9,59% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	936.248,90	0,00	0,00	992.114,34	55.865,44	5,97% ▲
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	323.386,59	0,00	0,00	334.085,25	10.698,66	3,31% ▲
	3.597.350,85	0,00	0,00	3.804.885,16	207.534,31	5,77%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	294.856,16	0,00	0,00	272.570,52	-22.285,64	-7,56% ▼
	294.856,16	0,00	0,00	272.570,52	-22.285,64	-7,56%

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

