

2024

Relatório Mensal

Agosto

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	222.142.883,52	27,69%	0,00		7º I a
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.373.075,21	1,29%	5.319.492.629,16	0,20%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	52.277.579,29	6,52%	32.995.563.494,35	0,16%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	9.892.589,03	1,23%	3.467.274.754,62	0,29%	7º I b
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.997.984,23	1,62%	233.389.313,75	5,57%	7º I b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	5.006.626,41	0,62%	2.176.041.462,72	0,23%	7º I b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	4.998.796,27	0,62%	435.554.807,42	1,15%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	3.011.307,84	0,38%	232.822.922,38	1,29%	7º I b
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	10.673.953,84	1,33%	250.910.720,22	4,25%	7º I b
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	16.555.729,30	2,06%	125.145.652,80	13,23%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.433.539,92	0,18%	4.410.336.954,15	0,03%	7º III a
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	39.997.089,42	4,99%	15.057.333.281,43	0,27%	7º III a
MAG CASH FI RENDA FIXA LP	2.025.514,93	0,25%	1.969.920.090,19	0,10%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	36.539.977,57	4,56%	3.601.057.030,35	1,01%	7º III a
LETRA FINANCEIRA BTG	28.005.759,78	3,49%	0,00		7º IV
LF BTG 18/05/2026 IPCA + 6,10%	16.970.164,41	2,12%	0,00		7º IV
LF BTG 19/03/2029 IPCA + 6,43%	10.460.176,50	1,30%	0,00		7º IV
LF BTG 26/05/2025 IPCA + 6,93%	6.617.256,42	0,82%	0,00		7º IV
LF SANTANDER 03/10/2025 IPCA + 6,05%	16.429.965,04	2,05%	0,00		7º IV
LF SANTANDER 05/10/2026 IPCA + 6,05%	16.433.560,96	2,05%	0,00		7º IV
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	53.027,16	0,01%	59.877.703,86	0,09%	7º V a
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1.565,51	0,00%	1.151.009,53	0,14%	7º V a
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	43.615,25	0,01%	0,00		7º V a
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	550.503,11	0,07%	29.048.012,44	1,90%	7º V a
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	12.370.021,12	1,54%	248.583.023,23	4,98%	7º V b
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	12.596.071,78	1,57%	253.940.442,94	4,96%	7º V b
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	33.490.496,91	4,18%	12.892.067.858,92	0,26%	7º V b

Investimentos

\$ 802.138.570,36

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 802.138.570,36

Governança (Pró Gestão)

📊 NIVEL 2 20/09/2026

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	7.262.291,42	0,91%	263.770.559,04	2,75%	7º V b
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1.925.478,76	0,24%	1.165.402.970,71	0,17%	8º I
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	6.970.694,52	0,87%	221.254.914,85	3,15%	8º I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	13.484.326,28	1,68%	1.263.586.408,92	1,07%	8º I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.438.574,40	0,68%	454.721.723,06	1,20%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	4.096.663,31	0,51%	822.113.263,16	0,50%	8º I
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	5.876.111,42	0,73%	797.695.836,05	0,74%	8º I
OCCAM FIC AÇÕES	21.452.771,24	2,67%	868.346.546,52	2,47%	8º I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	18.043.982,70	2,25%	468.365.610,05	3,85%	8º I
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.473.746,02	0,68%	243.015.292,34	2,25%	8º I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	10.553.607,55	1,32%	134.929.854,83	7,82%	8º I
SPX APACHE FIC AÇÕES	3.340.680,13	0,42%	789.711.291,97	0,42%	8º I
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.222.474,88	0,28%	585.382.543,19	0,38%	8º I
VINCI TOTAL RETURN INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.945.566,02	0,62%	130.330.125,71	3,79%	8º I
CAIXA EXPERT PIMCO INCOME INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCA...	2.039.416,28	0,25%	75.505.942,90	2,70%	9º II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	7.568.838,12	0,94%	128.760.709,53	5,88%	9º II
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	9.326.827,42	1,16%	27.839.938,94	33,50% ▲	9º II
SANTANDER GLOBAIS REAIS BDR ETF FIC AÇÕES	2.189.860,95	0,27%	60.403.961,70	3,63%	9º III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.674.718,02	0,46%	1.844.965.501,46	0,20%	9º III
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	13.752.286,04	1,71%	95.450.448,65	14,41%	10º I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	5.752.046,09	0,72%	147.272.793,81	3,91%	10º I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	2.213.465,03	0,28%	63.806.565,37	3,47%	10º I
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	9.206.589,07	1,15%	435.631.508,93	2,11%	10º I
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO	7.988.837,36	1,00%	142.020.898,29	5,63%	10º I
BB VOTORANTIM ENERGIA SUSTENTÁVEL II FIP INFRAESTRUTURA - ESUD11	117.182,22	0,01%	29.638.985,62	0,40%	10º II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIELABORADORA	20.990.630,00	2,62%	3.019.875.868,73	0,70%	10º II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP MULTIELABORADORA	1.676.394,47	0,21%	180.098.402,99	0,93%	10º II

Investimentos

\$ 802.138.570,36

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 802.138.570,36

Governança (Pró Gestão)

📊 NIVEL 2 20/09/2026

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	17.128,97	0,00%	12.866.366,30	0,13%	10º II
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.884.430,39	0,23%	76.507.874,15	2,46%	10º II
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGI...	11.751.704,08	1,47%	374.879.327,24	3,13%	10º II
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	4.707.024,02	0,59%	257.003.511,44	1,83%	10º II
NOVA RAPOSO FIP MULTIESTRATÉGIA - NVRP11	1.161.877,81	0,14%	174.273.968,54	0,67%	10º II
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	162.949,20	0,02%	1.337.237.740,40	0,01%	11º
CENESP FII - CNES11	4.869,00	0,00%	51.202.237,50	0,01%	11º
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	40.478,76	0,01%	7.789.807,62	0,52%	11º
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	2.875.217,68	0,36%	0,00		11º

Investimentos

\$ 802.138.570,36


Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 802.138.570,36

Governança (Pró Gestão)

 NIVEL 2 20/09/2026

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2040	15/07/2021	Curva - Taxa: 4,2800%	664	5.173,501181	3.435.204,78
NTN-B - 15/08/2040	26/07/2021	Curva - Taxa: 4,1850%	487	5.225,535746	2.544.835,91
NTN-B - 15/08/2040	23/08/2021	Curva - Taxa: 4,8200%	786	4.890,558645	3.843.979,09
NTN-B - 15/08/2040	22/09/2021	Curva - Taxa: 4,7900%	740	4.905,724065	3.630.235,81
NTN-B - 15/08/2040	26/10/2021	Curva - Taxa: 5,4500%	9.616	4.586,274903	44.101.619,47
NTN-B - 15/08/2040	29/10/2021	Curva - Taxa: 5,4900%	5.795	4.567,833857	26.470.597,20
NTN-B - 15/08/2040	23/11/2021	Curva - Taxa: 5,2700%	1.070	4.670,521959	4.997.458,50
NTN-B - 15/08/2040	17/12/2021	A mercado	3.380	4.285,944355	14.486.491,92
NTN-B - 15/08/2040	20/12/2021	Curva - Taxa: 5,2300%	4.550	4.689,528364	21.337.354,06
NTN-B - 15/08/2040	23/12/2021	Curva - Taxa: 5,1901%	2.480	4.708,595189	11.677.316,07
NTN-B - 15/08/2040	11/01/2022	Curva - Taxa: 5,6301%	2.350	4.504,043286	10.584.501,72
NTN-B - 15/08/2040	25/07/2022	Curva - Taxa: 6,2000%	1.500	4.256,813285	6.385.219,93
NTN-B - 15/08/2040	15/03/2024	Curva - Taxa: 5,7305%	2.273	4.459,082176	10.135.493,79
NTN-F - 01/01/2027	04/06/2018	Curva - Taxa: 11,1600%	8.169	994,530951	8.124.323,34
NTN-F - 01/01/2029	21/06/2018	Curva - Taxa: 11,8100%	37.673	960,859477	36.198.459,08
NTN-F - 01/01/2029	16/08/2018	Curva - Taxa: 11,6000%	14.670	967,266045	14.189.792,88

Investimentos

\$ 802.138.570,36

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 802.138.570,36

Governança (Pró Gestão)

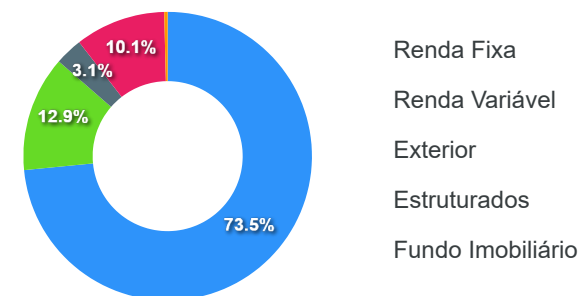
📅 NIVEL 2 20/09/2026

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	27,69%	222.142.883,52 72,31%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	15,68%	125.787.641,42 84,32%
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	9,97%	79.996.121,84 60,03%
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	11,83%	94.916.883,11 8,17%
7º V a - FIDC Cota Sênior	10,00%	0,08%	648.711,03 9,92%
7º V b - Fundos de RF - Crédito Privado	10,00%	8,19%	65.718.881,23 1,81%
8º I - Fundos de Ações	40,00%	12,94%	103.824.677,23 27,06%
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	2,36%	18.935.081,82 7,64%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,73%	5.864.578,97 9,27%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	4,85%	38.913.223,59 5,15%
10º II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	5,27%	42.306.371,96 -0,27%
11º - Fundos Imobiliários	10,00%	0,38%	3.083.514,64 9,62%

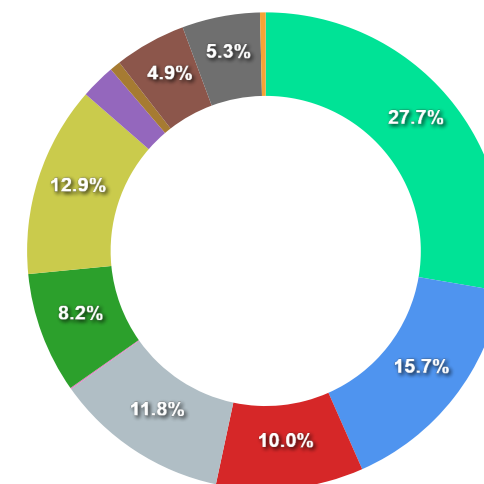
Governança (Pró Gestão)

NIVEL 2 20/09/2026

Segmentos



Artigos



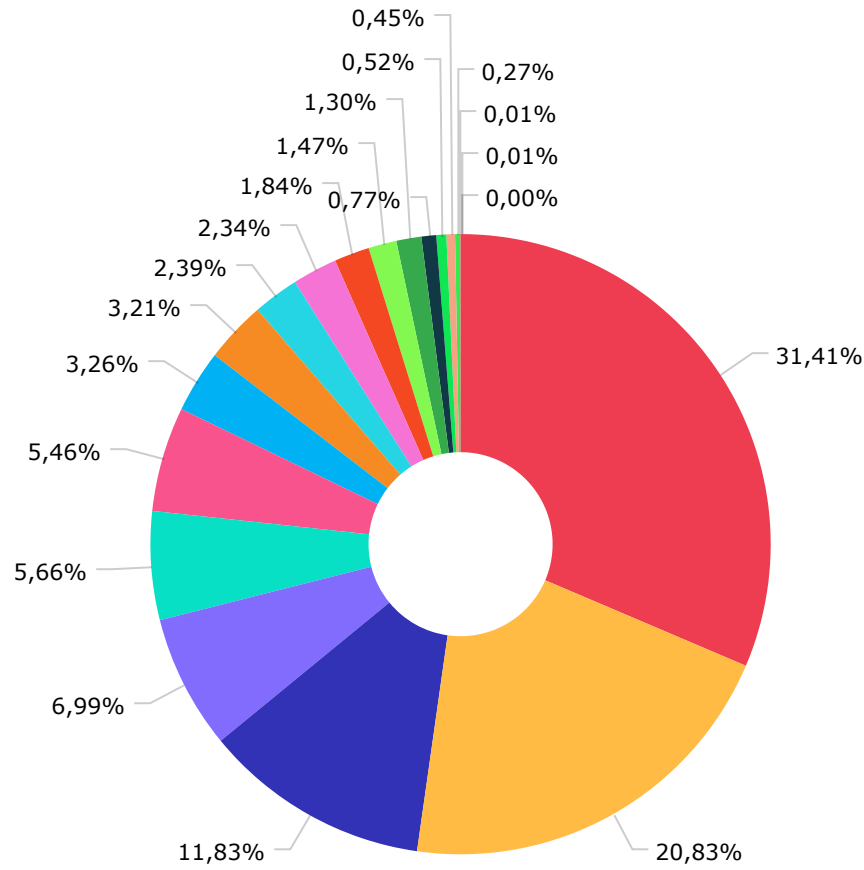
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	27,69%	0,00%	30,00%	100,00%	579.995.686,84	8° I - Fundos de Ações	12,94%	0,00%	19,00%	40,00%	217.030.750,91
7° I b - FI 100% Títulos TN	15,68%	0,00%	15,00%	100,00%	676.350.928,94	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	320.855.428,14
7° III a - FI Referenciados RF	9,97%	0,00%	7,00%	70,00%	481.500.877,41	9° II - Constituídos no Brasil	2,36%	0,00%	1,00%	10,00%	61.278.775,22
7° IV - Ativos Financeiros de ...	11,83%	0,00%	12,00%	20,00%	65.510.830,96	9° III - Ações - BDR Nível I	0,73%	0,00%	1,00%	10,00%	74.349.278,07
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,08%	0,00%	1,00%	10,00%	79.565.146,01	10° I - Fundos Multimercados	4,85%	0,00%	3,00%	10,00%	41.300.633,45
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	8,19%	0,00%	3,00%	10,00%	14.494.975,81	10° II - Fundos em Participaçõ...	5,27%	0,00%	5,00%	5,00%	-2.199.443,44
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	80.213.857,04	11° - Fundos Imobiliários	0,38%	0,00%	1,00%	5,00%	37.023.413,88

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
SANTANDER GLOBAIS REAIS BDR ETF FIC AÇÕES	1,94	16,47	6,68	10,36	24,68	45,79	8,96	18,86
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,97	8,24	3,05	5,81	13,19	29,02	0,12	0,25
CAIXA EXPERT PIMCO INCOME INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO LP	1,06	6,69	4,02	6,19	12,76		1,30	2,73
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	0,74	2,84	1,19	1,69	7,29		1,92	4,04
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP MULTISTRATÉGIA	9,90	3,65	17,40	8,64	-5,87			
CENESP FII - CNES11	0,00		-8,54				9,03	19,03
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA								
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO								
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	0,61		1,52				1,28	2,69
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA								
130% DO CDI - BENCHMARK								
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	1,13	9,32	3,37	6,84	14,79	35,38		
CDI - BENCHMARK								
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,04	8,38	3,14	5,78	13,36	26,79	0,18	0,38
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,94	7,75	2,79	5,69	12,44	28,47	0,04	0,09
MAG CASH FI RENDA FIXA LP	0,93	7,53	2,77	5,56	11,90	27,26	0,07	0,16
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91	7,44	2,69	5,42	11,71	27,16	0,04	0,08
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,87	7,07	2,59	5,21	11,15	26,18	0,01	0,01
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,79	6,39	2,33	4,70	10,11	23,82	0,01	0,02
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,99	5,91	2,38	3,45	8,89	23,91	1,64	3,45
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,41	-1,57	-1,39	-0,64	-7,56	-6,65	0,10	0,21
CDI + 3,50% AO ANO - BENCHMARK								
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	3,27	0,78	2,87	-0,65	209,53	172,87		

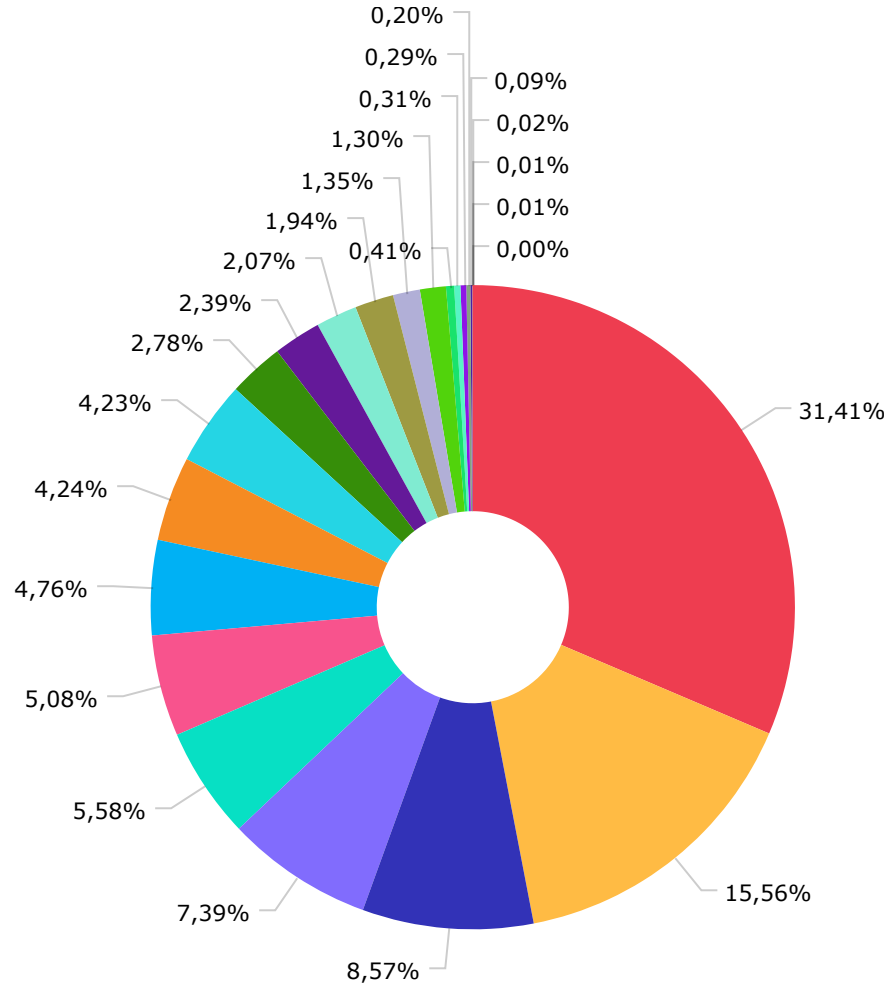
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-19,45	0,40	-0,51	-12,01	170,80	384,10		
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	0,55	42,25	13,74	27,72	48,00	71,14		
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,93	38,83	15,72	21,12	47,75	73,52	9,12	19,21
IBOVESPA - BENCHMARK	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18		
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,06	2,81	6,43	7,14	23,37	57,00	9,12	19,21
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6,34	5,14	11,05	7,73	21,80	33,88	4,84	10,19
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	6,80	2,47	10,02	1,71	13,82	26,58	6,07	12,78
OCCAM FIC AÇÕES	5,09	-0,93	9,63	1,81	13,15	12,75	5,42	11,42
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,92	-1,32	10,26	0,70	12,84	23,24	6,26	13,19
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	6,44	-1,21	13,61	3,86	12,47	17,83	6,38	13,44
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	3,19	3,82	6,20	4,47	12,27		2,76	5,82
VINCI TOTAL RETURN INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4,33	1,64	9,36	5,84	11,91	24,11	6,02	12,68
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	3,03	4,04	5,87	4,32	11,17	10,54	2,69	5,67
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	5,14	-2,30	7,73	-0,28	9,56	23,34	7,06	14,87
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4,94	-14,38	2,72	-7,95	-0,82	15,38	10,06	21,18
IBX - BENCHMARK	6,60	1,79	11,34	5,58	18,00	22,90		
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	4,64	2,51	9,46	4,31	12,73	15,54	7,35	15,48
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4,49	4,31	11,15	5,88	12,40	13,42	6,94	14,61
SPX APACHE FIC AÇÕES	3,97	-2,04	8,35	1,34	10,86	27,32	6,14	12,94
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,60	4,60	1,53	3,33	7,94	20,67		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64	4,56	1,66	3,36	7,81	20,28	1,25	2,63
IMA-B - BENCHMARK	0,52	1,49	1,63	1,40	5,32	19,81		

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,09	-3,88	-1,09	-1,45	-1,08	6,69	5,37	11,30
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,59	4,88	1,91	3,56	8,14	21,08		
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	2,19	5,72	5,77	5,81	13,09	37,29	2,24	4,71
IPCA - BENCHMARK	-0,02	2,85	0,57	1,58	4,24	9,04		
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,08	5,32	2,64	3,65	8,73	21,59	1,77	3,74
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,60	3,70	1,80	2,75	8,01	21,19	0,83	1,76
IPCA + 15,00% AO ANO - BENCHMARK	1,21	12,96	4,15	8,93	19,87	44,21		
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	-5,01	-39,76	-13,88	-24,40	-45,50		0,03	0,06
IPCA + 8,00% AO ANO - BENCHMARK	0,65	8,30	2,52	5,56	12,58	27,19		
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-41,85	-20,44	-26,03	-26,46	-20,30	-20,13	67,14	141,40
IRF-M - BENCHMARK	0,66	3,54	1,70	2,39	8,26	24,46		
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	0,75	6,16	2,31	4,50	10,15	25,13	0,30	0,64
SELIC - BENCHMARK	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91	7,71	2,77	5,61	12,12	27,88	0,04	0,08
SMLL - BENCHMARK	4,51	-9,69	5,65	-3,81	-2,18	-4,07		
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,16	3,37	9,69	4,81	10,72	11,48	6,26	13,19
IPCA + 6,00% AO ANO - BENCHMARK	0,49	6,95	2,05	4,58	10,49	22,52		
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,19	12,33	6,41	13,84	13,24			
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,18	3,02	-0,54	3,37	2,86	18,71		

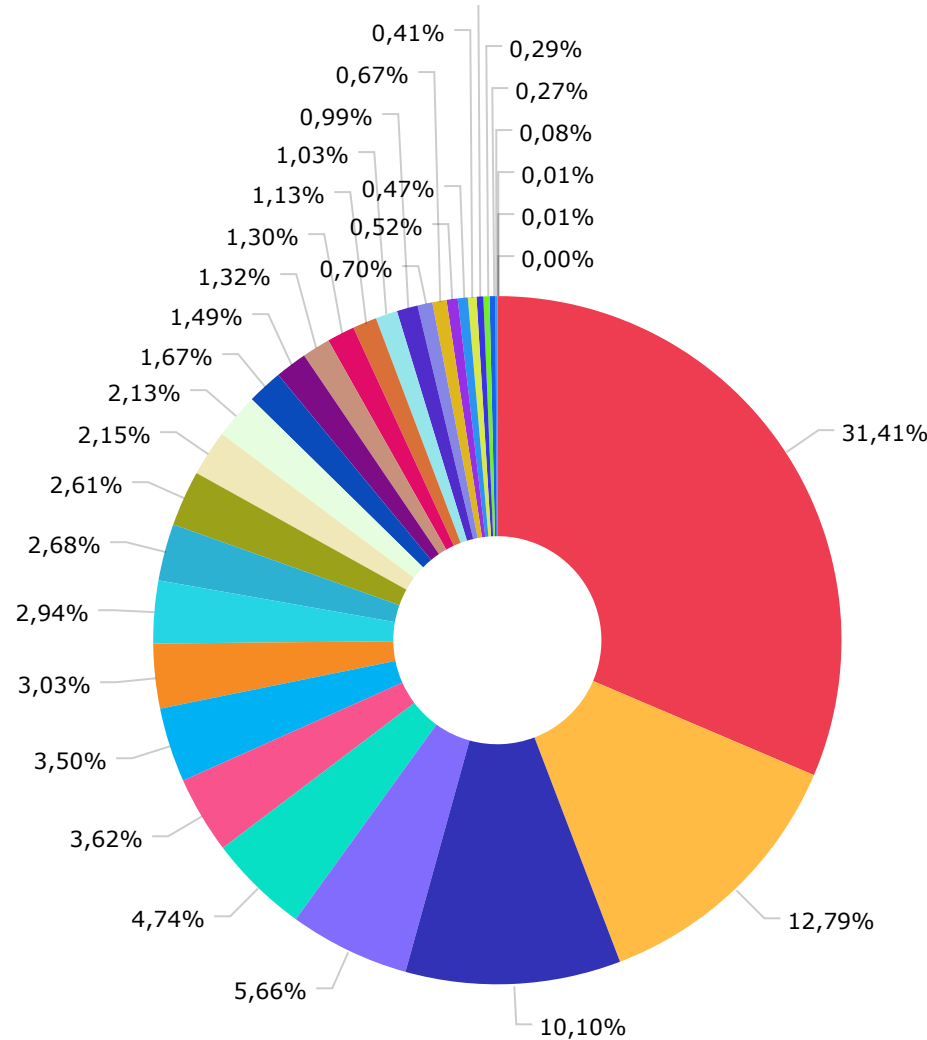
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	0,31	2,50	-0,10	-0,36	2,02	-5,29		
NOVA RAPOSO FIP MULTIESTRATÉGIA - NVRP11	-0,10	-0,76	-0,31	-0,58	-9,30	1,35	0,00	0,00
MSCI WORLD - BENCHMARK	2,40	34,97	14,68	24,52	40,91	52,19		
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	6,37	21,29	20,93	14,32	35,81	30,34	15,31	32,25
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2,65	30,88	13,89	23,60	34,72	40,75	12,27	25,84
IFIX - BENCHMARK	0,86	2,48	0,33	1,00	5,63	14,02		
BB VOTORANTIM ENERGIA SUSTENTÁVEL II FIP INFRAESTRUTURA - ESUD11	0,81	4,75	1,66	3,67	8,62	-79,34		
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	0,42	-15,35	-9,06	-15,91	-17,70	-28,69	6,01	12,65
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	0,00	2,44	5,00	5,00	-25,00	-55,79	20,12	42,37
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11							0,00	0,00



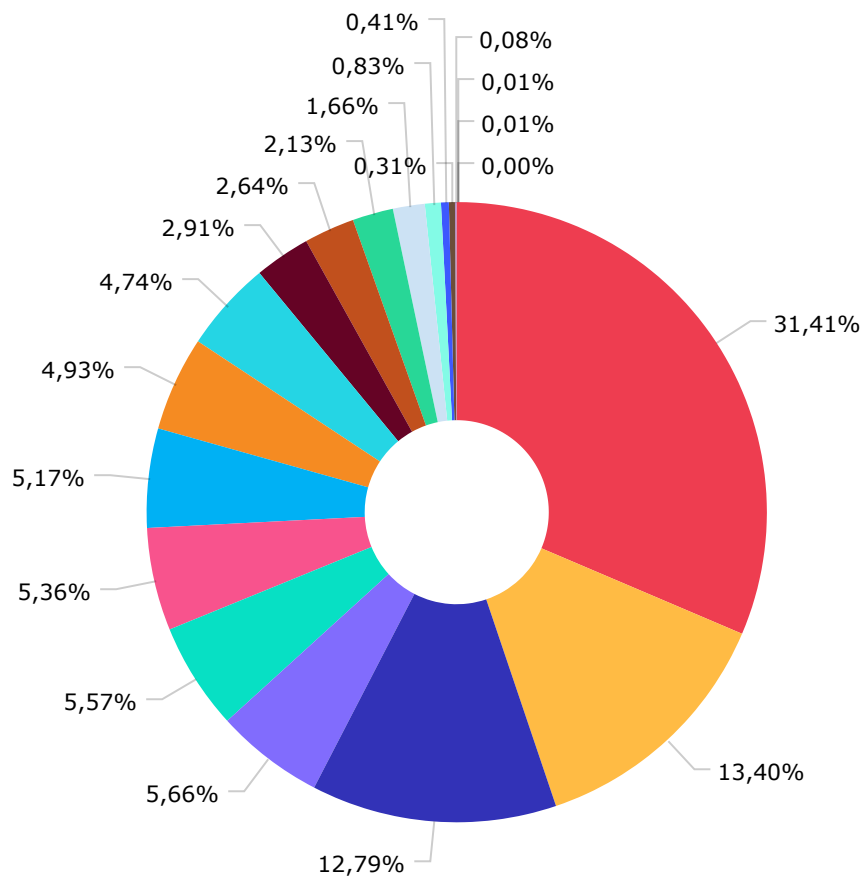
Títulos Públicos	222.142.883,52
CDI	147.332.189,19
Ibovespa	83.650.496,12
Não definido	49.404.769,39
Selic	39.997.089,42
IPCA + 6,00% ao ano	38.611.235,91
IPCA	23.043.974,96
IBX	22.701.117,83
MSCI WORLD	16.895.665,54
IRF-M	16.555.729,30
IMA-B	12.997.984,23
IDKA IPCA 2 Anos	10.373.075,21
IMA-B 5	9.206.589,07
SMLL	5.438.574,40
Global BDRX	3.674.718,02
IFIX	3.195.827,86
IPCA + 8,00% ao ano	1.884.430,39
CDI + 3,50% ao ano	54.592,67
130% do CDI	43.615,25
IPCA + 15,00% ao ano	17.128,97



Títulos Públicos	222.142.883,52
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	10.027.563,90
Ações Livre	60.622.092,93
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	52.277.579,29
Ações Valor/Crescimento	39.496.753,94
Fundos de Participações	35.922.953,47
Renda Fixa Duração Livre Soberano	33.677.360,75
Não classificado	30.016.890,97
Renda Fixa Indexados	29.940.112,35
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	19.632.312,54
Ações Investimento no Exterior	16.895.665,54
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	14.621.586,71
Multimercados Juros e Moedas	13.752.286,04
Ações Dividendos	9.570.409,33
Multimercados Balanceados	9.206.589,07
FII TVM Gestão Ativa	2.875.217,68
Multimercados Capital Protegido	2.213.465,03
Multimercados Investimento no Exterior	2.039.416,28
Renda Fixa Simples	1.433.539,92
FIDC Outros	605.095,78
FII Híbrido Gestão Ativa	162.949,20
FIDC Fomento Mercantil	43.615,25
FII Desenvolvimento para Venda Gestão Ativa	40.478,76
FII Renda Gestão Passiva	4.869,00



TESOURO NACIONAL	222.142.883,52
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	90.443.467,88
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	71.433.267,68
BANCO BRADESCO S.A.	39.997.089,42
ITAU UNIBANCO S.A.	33.490.496,91
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	25.612.820,82
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	24.736.402,03
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSO...	21.452.771,24
CAIXA DTVM	20.808.192,89
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	18.922.900,68
CLARITAS ADMINISTRAÇÃO DE RECU...	18.472.183,20
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.211.449,26
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	15.031.346,07
KINEA INVESTIMENTOS LTDA.	11.792.182,84
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	10.553.607,55
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT...	9.326.827,42
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECU...	9.206.589,07
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	7.988.837,36
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	7.262.291,42
BAYES CAPITAL MANAGEMENT INVES...	6.970.694,52
VINCI GESTORA DE RECURSOS LTDA	4.945.566,02
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	4.707.024,02
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPA...	3.674.718,02
SPX EQUITIES GESTAO DE RECURSO...	3.340.680,13
PLANNER CORRETORA DE VALORES S...	2.875.217,68
TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA	2.222.474,88
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS L...	2.025.514,93
ALASKA INVESTIMENTOS LTDA	1.925.478,76
PETRA CAPITAL GESTÃO DE INVEST...	550.503,11
VILA RICA CAPITAL GESTORA DE R...	53.027,16
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIR...	43.615,25
GENIAL GESTÃO LTDA	1.565,51



TESOURO NACIONAL	222.142.883,52
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	94.793.633,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	90.443.467,88
BANCO BRADESCO S.A.	39.997.089,42
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	39.381.908,14
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	37.904.072,54
SANTANDER DISTRIBUIDORA DE TIT...	36.539.977,57
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	34.893.290,11
ITAU UNIBANCO S.A.	33.490.496,91
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	20.570.383,56
INTRAG DTVM LTDA	18.641.790,46
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	15.031.346,07
LIONS TRUST ADMINISTRADORA DE ...	11.751.704,08
S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA...	5.893.240,39
PLANNER CORRETORA DE VALORES S...	2.875.217,68
BANCO DAYCOVAL S.A.	2.222.474,88
FINAXIS CORRETORA DE TÍTULOS E...	550.503,11
BRL TRUST DISTRIBUIDORA DE TÍT...	53.027,16
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIR...	43.615,25
GENIAL INVESTIMENTOS CORRETORA...	1.565,51

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	724.709.930,92	83.681.971,65	75.022.184,99	732.002.229,11	-1.367.488,47	-1.367.488,47	-0,19% ▼	-0,19%	1,02%	1,02%	-18,63%	1,58%
Fevereiro	732.002.229,11	47.954.822,38	44.581.310,30	742.992.706,23	7.616.965,04	6.249.476,57	1,04% ▲	0,85%	1,20%	2,23%	38,12%	1,58%
Março	742.992.706,23	101.229.048,59	98.195.648,14	752.425.004,04	6.398.897,36	12.648.373,93	0,86% ▲	1,71%	0,60%	2,84%	60,21%	1,12%
Abril	752.425.004,04	26.454.223,06	23.230.491,58	753.692.238,05	-1.956.497,47	10.691.876,46	-0,26% ▼	1,45%	0,82%	3,68%	39,40%	1,32%
Mai	753.692.238,05	18.860.975,05	15.363.546,33	759.522.954,46	2.333.287,69	13.025.164,15	0,31% ▲	1,76%	0,89%	4,60%	38,26%	1,12%
Junho	759.522.954,46	40.408.034,25	35.888.937,77	770.563.743,95	6.521.693,01	19.546.857,16	0,85% ▲	2,63%	0,66%	5,28%	49,81%	1,27%
Julho	770.563.743,95	56.767.289,32	50.661.935,93	787.431.258,57	10.762.161,23	30.309.018,39	1,39% ▲	4,05%	0,73%	6,05%	66,94%	1,33%
Agosto	787.431.258,57	135.621.451,48	131.317.009,20	802.138.570,36	10.402.869,51	40.711.887,90	1,31% ▲	5,42%	0,30%	6,37%	85,09%	1,60%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	12.648.373,93	1,71%	2,84%
2º Trim	6.898.483,23	0,90%	2,38%
1º Sem	19.546.857,16	2,63%	5,28%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

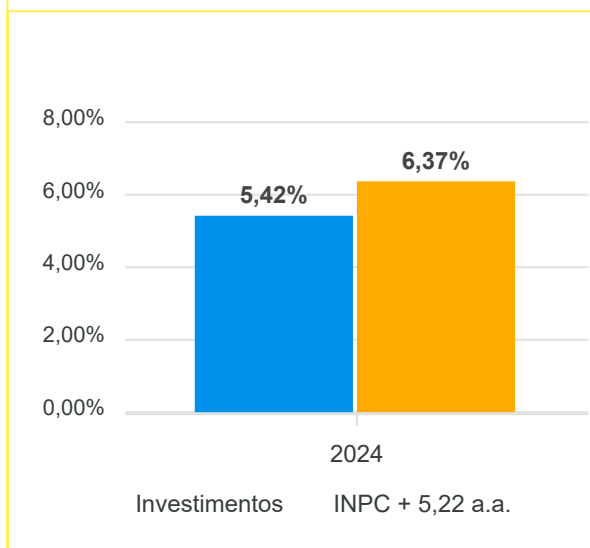


Gráfico Risco x Retorno

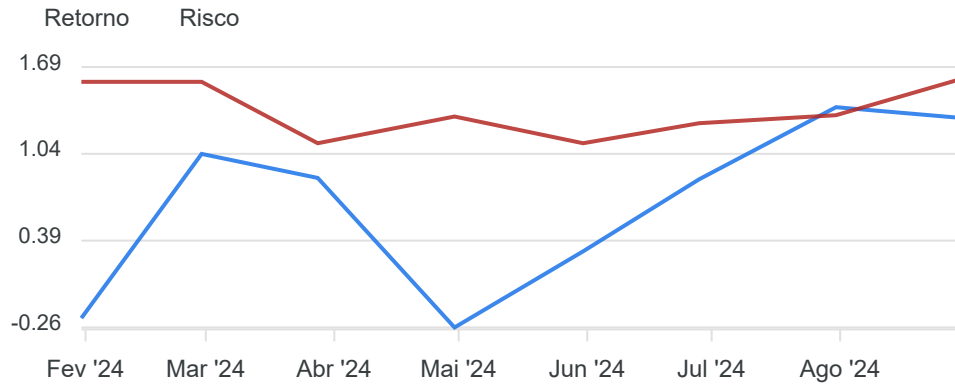
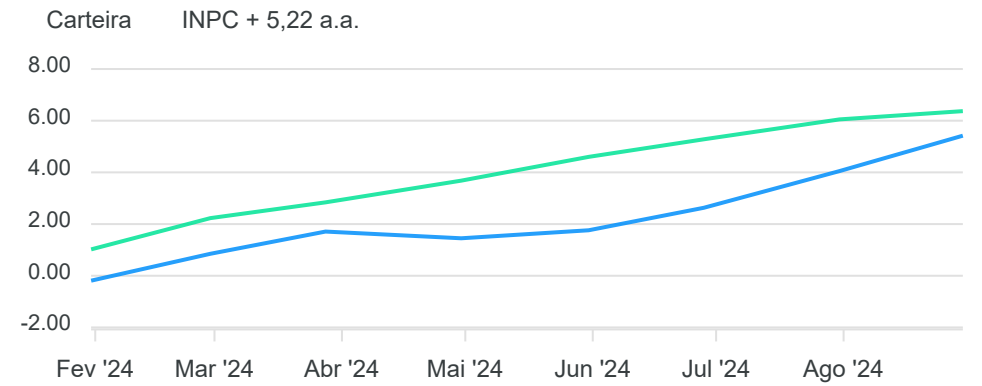
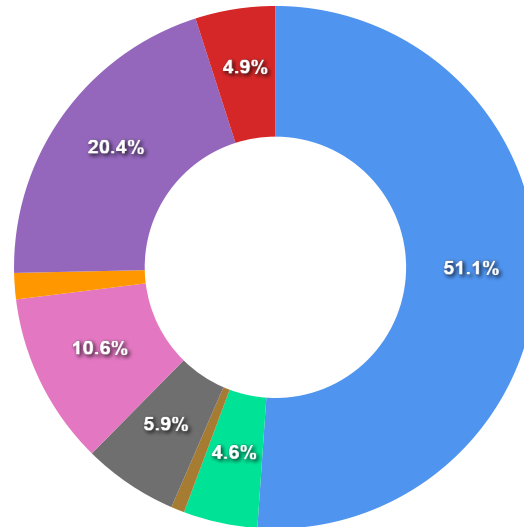


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/08/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	409.906.822,17	51,10
Até D+180	36.772.291,93	4,58
Até D+360	6.617.256,42	0,82
Até D+720	47.152.415,49	5,88
Até D+1800	85.406.312,76	10,65
Até D+3600	12.997.984,23	1,62
Acima D+3600	163.630.308,24	20,40
Indeterminado	39.655.179,14	4,94



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	224.994.863,96	0,00	4.553.426,41	222.142.883,52	1.701.445,97	0,76% ▲	-
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	15.883.535,58	0,00	15.691.351,15	0,00	-192.184,43	-1,21% ▼	2,49%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.401.358,12	32.548.504,71	32.566.888,40	1.433.539,92	50.565,49	0,15% ▲	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.307.579,28	0,00	0,00	10.373.075,21	65.495,93	0,64% ▲	1,25%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.890.661,11	0,00	24.058.541,09	0,00	167.879,98	0,70% ▲	2,45%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	12.238.444,21	0,00	0,00	12.370.021,12	131.576,91	1,08% ▲	1,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.863.682,19	0,00	12.933.417,96	0,00	69.735,77	0,54% ▲	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	10.125.478,67	0,00	294.769,18	9.892.589,03	61.879,54	0,61% ▲	1,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.626.901,04	0,00	4.651.670,44	0,00	24.769,40	0,54% ▲	0,09%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	39.634.581,22	0,00	0,00	39.997.089,42	362.508,20	0,91% ▲	0,04%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.944.634,06	0,00	2.958.653,30	0,00	14.019,24	0,48% ▲	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.130.964,83	0,00	8.174.563,85	0,00	43.599,02	0,54% ▲	-
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.967.657,76	0,00	7.004.552,52	0,00	36.894,76	0,53% ▲	-
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.276.045,32	0,00	372.581,39	12.997.984,23	94.520,30	0,71% ▲	5,37%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	2.989.297,23	0,00	0,00	3.011.307,84	22.010,61	0,74% ▲	1,92%
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	6.514.324,90	6.000.000,00	0,00	12.596.071,78	81.746,88	0,65% ▲	0,12%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	51.346,08	0,00	0,00	53.027,16	1.681,08	3,27% ▲	-
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	33.180.043,66	0,00	0,00	33.490.496,91	310.453,25	0,94% ▲	0,04%
LETRA FINANCEIRA BTG	27.829.165,82	0,00	0,00	28.005.759,78	176.593,96	0,63% ▲	-
LF BTG 18/05/2026 IPCA + 6,10%	16.841.431,41	0,00	0,00	16.970.164,41	128.733,00	0,76% ▲	-
LF BTG 19/03/2029 IPCA + 6,43%	10.377.040,48	0,00	0,00	10.460.176,50	83.136,02	0,80% ▲	-
LF BTG 26/05/2025 IPCA + 6,93%	6.556.819,42	0,00	0,00	6.617.256,42	60.437,00	0,92% ▲	-
LF SANTANDER 03/10/2025 IPCA + 6,05%	16.311.663,03	0,00	0,00	16.429.965,04	118.302,01	0,73% ▲	-
LF SANTANDER 05/10/2026 IPCA + 6,05%	16.315.233,16	0,00	0,00	16.433.560,96	118.327,80	0,73% ▲	-
MAG CASH FI RENDA FIXA LP	2.006.795,87	0,00	0,00	2.025.514,93	18.719,06	0,93% ▲	0,07%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1.943,47	0,00	271,54	1.565,51	-106,42	-5,48% ▼	-

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	47.374,21	0,00	0,00	43.615,25	-3.758,96	-7,93% ▼	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	552.746,05	0,00	0,00	550.503,11	-2.242,94	-0,41% ▼	0,10%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	20.550.995,99	0,00	10.000.000,00	10.673.953,84	122.957,85	0,60% ▲	0,83%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	35.812.590,96	400.000,00	0,00	36.539.977,57	327.386,61	0,90% ▲	0,04%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	6.496.383,77	10.000.000,00	0,00	16.555.729,30	59.345,53	0,36% ▲	0,30%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	7.187.864,57	0,00	0,00	7.262.291,42	74.426,85	1,04% ▲	0,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	58.900.000,00	6.700.000,00	52.277.579,29	77.579,29	0,13% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.006.626,41	6.626,41	0,13% ▲	-
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	4.998.796,27	-1.203,73	-0,02% ▼	-
	596.909.447,43	117.848.504,71	129.960.687,23	589.211.122,15	4.413.857,24	0,74%	0,25%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1.834.829,73	0,00	0,00	1.925.478,76	90.649,03	4,94% ▲	10,06%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	6.630.210,58	0,00	0,00	6.970.694,52	340.483,94	5,14% ▲	7,06%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	12.904.496,87	0,00	0,00	13.484.326,28	579.829,41	4,49% ▲	6,94%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.272.137,21	0,00	0,00	5.438.574,40	166.437,19	3,16% ▲	6,26%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.835.653,19	0,00	0,00	4.096.663,31	261.010,12	6,80% ▲	6,07%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	5.615.451,33	0,00	0,00	5.876.111,42	260.660,09	4,64% ▲	7,35%
OCCAM FIC AÇÕES	20.413.773,40	0,00	0,00	21.452.771,24	1.038.997,84	5,09% ▲	5,42%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	17.197.502,65	0,00	0,00	18.043.982,70	846.480,05	4,92% ▲	6,26%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.147.478,24	0,00	0,00	5.473.746,02	326.267,78	6,34% ▲	4,84%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	9.915.067,03	0,00	0,00	10.553.607,55	638.540,52	6,44% ▲	6,38%
SPX APACHE FIC AÇÕES	3.213.043,35	0,00	0,00	3.340.680,13	127.636,78	3,97% ▲	6,14%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.135.840,99	0,00	0,00	2.222.474,88	86.633,89	4,06% ▲	9,12%
VINCI TOTAL RETURN INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	4.945.566,02	-54.433,98	-1,09% ▼	6,02%
-	94.115.484,57	5.000.000,00	0,00	103.824.677,23	4.709.192,66	4,75%	6,34%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB VOTORANTIM ENERGIA SUSTENTÁVEL II FIP INFRAESTRUTURA - ESUD11	116.259,28	0,00	0,00	117.182,22	922,94	0,79% ▲	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	21.028.911,00	0,00	0,00	20.990.630,00	-38.281,00	-0,18% ▼	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP MULTIESTRATÉGIA	917.758,37	772.946,77	0,00	1.676.394,47	-14.310,67	-0,85% ▼	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	18.031,67	0,00	0,00	17.128,97	-902,70	-5,01% ▼	0,03%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	3.240.438,73	0,00	1.354.679,80	1.884.430,39	-1.328,54	-0,04% ▼	67,14%
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	13.602.619,18	0,00	0,00	13.752.286,04	149.666,86	1,10% ▲	1,64%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	5.574.080,50	0,00	0,00	5.752.046,09	177.965,59	3,19% ▲	2,76%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	2.148.373,40	0,00	0,00	2.213.465,03	65.091,63	3,03% ▲	2,69%
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	5.104.772,78	4.000.000,00	0,00	9.206.589,07	101.816,29	1,12% ▲	2,24%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	11.715.422,80	0,00	0,00	11.751.704,08	36.281,28	0,31% ▲	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	4.715.916,22	0,00	0,00	4.707.024,02	-8.892,20	-0,19% ▼	-
NOVA RAPOSO FIP MULTIESTRATÉGIA - NVRP11	1.162.961,78	0,00	0,00	1.161.877,81	-1.083,97	-0,09% ▼	0,00%
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO	0,00	8.000.000,00	0,00	7.988.837,36	-11.162,64	-0,14% ▼	-
-	69.345.545,71	12.772.946,77	1.354.679,80	81.219.595,55	455.782,87	0,56%	2,62%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	162.267,54	0,00	1.623,00	162.949,20	2.304,66	1,42% ▲	6,01%
CENESP FII - CNES11	4.869,00	0,00	19,17	4.869,00	19,17	0,39% ▲	9,03%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	40.478,76	0,00	0,00	40.478,76	0,00	0,00%	20,12%
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	2.879.722,73	0,00	0,00	2.875.217,68	-4.505,05	-0,16% ▼	0,00%
-	3.087.338,03	0,00	1.642,17	3.083.514,64	-2.181,22	-0,07%	0,60%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA EXPERT PIMCO INCOME INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO LP	2.018.056,65	0,00	0,00	2.039.416,28	21.359,63	1,06% ▲	1,30%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	7.115.628,64	0,00	0,00	7.568.838,12	453.209,48	6,37% ▲	15,31%
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	9.086.474,95	0,00	0,00	9.326.827,42	240.352,47	2,65% ▲	12,27%
SANTANDER GLOBAIS REAIS BDR ETF FIC AÇÕES	2.148.123,17	0,00	0,00	2.189.860,95	41.737,78	1,94% ▲	8,96%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.605.159,42	0,00	0,00	3.674.718,02	69.558,60	1,93% ▲	9,12%
	23.973.442,83	0,00	0,00	24.799.660,79	826.217,96	3,45%	10,19%

Cenário Econômico

Mantendo o bom humor de julho, com a manutenção do patamar de taxa de juros e a redução das expectativas de inflação, fizeram com que o mês de agosto também apresentasse um forte desempenho para as carteiras de investimentos. Os ativos de renda fixa, embora tenham tido um desempenho inferior ao de julho, ainda assim contribuíram positivamente. 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. Reiteramos que a diversificação e o acompanhamento constante do mercado continuam sendo estratégias importantes para obtenção de bons resultados.

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, a manutenção do patamar de taxa de juros e a redução das expectativas de inflação, fizeram com que o mês de agosto também apresentasse um bom desempenho para a carteira de investimentos. Os ativos de renda fixa, embora tenham tido um desempenho inferior ao de julho, ainda assim contribuíram positivamente. 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. A renda fixa segue como referência de rentabilidade, com o CDI se destacando na relação risco x retorno.

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, 13 de setembro de 2024.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **ITU - SP** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Agosto/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 **ITU - SP** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Agosto/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 **ITU - SP** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

