

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	257.315.405,52	31,88%	0,00		7º I a
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.506.894,95	1,30%	4.919.072.193,80	0,21%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.533.632,91	1,31%	30.241.561.842,62	0,03%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE...	10.030.214,79	1,24%	3.760.040.315,03	0,27%	7º I b
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.865.281,28	1,59%	231.006.525,51	5,57%	7º I b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	5.076.440,93	0,63%	2.443.726.869,45	0,21%	7º I b
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	5.048.517,29	0,63%	496.171.535,73	1,02%	7º I b
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	16.829.144,90	2,09%	121.715.286,05	13,83%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.168.295,36	0,14%	4.036.357.184,84	0,03%	7º III a
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	45.793.549,36	5,67%	15.416.999.740,59	0,30%	7º III a
MAG CASH FI RENDA FIXA LP	10.168.896,14	1,26%	1.972.478.195,94	0,52%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	52.062.881,05	6,45%	3.555.599.377,38	1,46%	7º III a
LETRA FINANCEIRA BTG	28.374.361,12	3,52%	0,00		7º IV
LF BTG 18/05/2026 IPCA + 6,10%	17.260.370,31	2,14%	0,00		7º IV
LF BTG 19/03/2029 IPCA + 6,43%	10.641.925,77	1,32%	0,00		7º IV
LF BTG 26/05/2025 IPCA + 6,93%	6.728.950,00	0,83%	0,00		7º IV
LF SANTANDER 03/10/2025 IPCA + 6,05%	16.659.101,38	2,06%	0,00		7º IV
LF SANTANDER 05/10/2026 IPCA + 6,05%	16.662.747,47	2,06%	0,00		7º IV
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	47.943,32	0,01%	54.137.100,56	0,09%	7º V a
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1.522,35	0,00%	1.119.278,76	0,14%	7º V a
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	42.856,37	0,01%	0,00		7º V a
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	545.644,71	0,07%	28.791.652,24	1,90%	7º V a
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	12.411.598,71	1,54%	210.982.426,16	5,88% ▲	7º V b
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO ...	20.180.349,70	2,50%	3.517.529.593,29	0,57%	7º V b
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	12.827.117,69	1,59%	249.391.956,12	5,14% ▲	7º V b
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	19.050.134,01	2,36%	14.797.999.346,95	0,13%	7º V b
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	12.459.066,18	1,54%	286.096.606,04	4,35%	7º V b

Investimentos

\$ 807.110.370,56

Disponibilidades Financeiras

\$ 203.761,81

Total Carteira

\$ 807.314.132,37

Governança (Pró Gestão)

📊 NIVEL 2 20/09/2026

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1.800.437,63	0,22%	1.034.517.804,12	0,17%	8º I
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	6.755.658,49	0,84%	219.710.090,17	3,07%	8º I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	13.108.208,38	1,62%	1.181.577.816,36	1,11%	8º I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.303.747,38	0,66%	401.576.805,70	1,32%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.966.191,61	0,49%	789.349.967,85	0,50%	8º I
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	5.536.862,07	0,69%	702.472.570,99	0,79%	8º I
KÍNITRO FI AÇÕES	1.997.960,28	0,25%	164.026.654,04	1,22%	8º I
OCCAM FIC AÇÕES	20.378.346,11	2,52%	796.372.374,58	2,56%	8º I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.029.511,02	0,75%	441.119.896,85	1,37%	8º I
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	8.351.721,36	1,03%	259.012.548,85	3,22%	8º I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	10.071.043,22	1,25%	122.325.097,55	8,23%	8º I
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.232.703,79	0,28%	613.433.250,74	0,36%	8º I
VINCI TOTAL RETURN INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.757.285,59	0,59%	129.150.351,74	3,68%	8º I
CAIXA EXPERT PIMCO INCOME INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCA...	2.041.163,23	0,25%	159.213.392,58	1,28%	9º II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	8.695.663,20	1,08%	138.994.582,89	6,26%	9º II
SANTANDER GLOBAIS REAIS BDR ETF FIC AÇÕES	2.198.699,23	0,27%	96.353.965,60	2,28%	9º III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.864.870,76	0,48%	1.887.417.257,23	0,20%	9º III
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	13.789.243,68	1,71%	95.807.625,74	14,39%	10º I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	5.677.035,80	0,70%	145.352.363,37	3,91%	10º I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	2.182.787,42	0,27%	62.922.244,89	3,47%	10º I
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	9.242.387,70	1,15%	443.407.585,42	2,08%	10º I
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO	7.936.975,57	0,98%	141.098.930,04	5,63%	10º I
BB VOTORANTIM ENERGIA SUSTENTÁVEL II FIP INFRAESTRUTURA - ESUD11	118.695,00	0,01%	30.016.186,14	0,40%	10º II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	20.889.827,00	2,59%	3.005.373.522,79	0,70%	10º II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP MULTIESTRATÉGIA	1.645.797,36	0,20%	176.811.305,41	0,93%	10º II
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	15.325,74	0,00%	11.511.889,50	0,13%	10º II
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.905.752,93	0,24%	77.373.569,12	2,46%	10º II

Investimentos

\$ 807.110.370,56

Disponibilidades Financeiras

\$ 203.761,81

Total Carteira


\$ 807.314.132,37

Governança (Pró Gestão)

📄 NIVEL 2 20/09/2026

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGI...	11.574.916,33	1,43%	369.239.797,78	3,13%	10º II
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	5.559.417,02	0,69%	303.544.169,06	1,83%	10º II
NOVA RAPOSO FIP MULTIESTRATÉGIA - NVRP11	1.159.567,18	0,14%	173.935.077,15	0,67%	10º II
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	141.201,00	0,02%	1.158.761.787,00	0,01%	11º
CENESP FII - CNES11	4.219,80	0,00%	44.375.272,50	0,01%	11º
KINEA AQUISIÇÕES RESIDENCIAIS RESP LIMITADA FII - KRES11	3.994.947,00	0,49%	0,00		11º
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	23.130,72	0,00%	4.451.318,64	0,52%	11º
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	2.866.226,39	0,36%	0,00		11º


Investimentos

 807.110.370,56


Disponibilidades Financeiras

 203.761,81

Total Carteira

 807.314.132,37

Governança (Pró Gestão)

 NIVEL 2 20/09/2026

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2026	13/09/2024	Curva - Taxa: 6,5810%	2.794	4.361,967823	12.187.338,10
NTN-B - 15/05/2027	24/10/2024	Curva - Taxa: 6,8110%	2.282	4.392,902932	10.024.604,49
NTN-B - 15/08/2028	24/10/2024	Curva - Taxa: 6,9200%	2.343	4.279,193153	10.026.149,56
NTN-B - 15/08/2040	15/07/2021	Curva - Taxa: 4,2800%	664	5.248,116603	3.484.749,42
NTN-B - 15/08/2040	26/07/2021	Curva - Taxa: 4,1850%	487	5.300,060468	2.581.129,45
NTN-B - 15/08/2040	23/08/2021	Curva - Taxa: 4,8200%	786	4.965,571877	3.902.939,50
NTN-B - 15/08/2040	22/09/2021	Curva - Taxa: 4,7900%	740	4.980,717825	3.685.731,19
NTN-B - 15/08/2040	26/10/2021	Curva - Taxa: 5,4500%	9.616	4.661,492525	44.824.912,12
NTN-B - 15/08/2040	29/10/2021	Curva - Taxa: 5,4900%	5.795	4.643,056625	26.906.513,14
NTN-B - 15/08/2040	23/11/2021	Curva - Taxa: 5,2700%	1.070	4.745,705734	5.077.905,14
NTN-B - 15/08/2040	17/12/2021	A mercado	3.380	4.127,503333	13.950.961,27
NTN-B - 15/08/2040	20/12/2021	Curva - Taxa: 5,2300%	4.550	4.764,702273	21.679.395,34
NTN-B - 15/08/2040	23/12/2021	Curva - Taxa: 5,1901%	2.480	4.783,759657	11.863.723,95
NTN-B - 15/08/2040	11/01/2022	Curva - Taxa: 5,6301%	2.350	4.579,278494	10.761.304,46
NTN-B - 15/08/2040	25/07/2022	Curva - Taxa: 6,2000%	1.500	4.331,984495	6.497.976,74
NTN-B - 15/08/2040	15/03/2024	Curva - Taxa: 5,7305%	2.273	4.534,314368	10.306.496,56
NTN-F - 01/01/2027	04/06/2018	Curva - Taxa: 11,1600%	8.169	1.013,073753	8.275.799,49
NTN-F - 01/01/2029	21/06/2018	Curva - Taxa: 11,8100%	37.673	979,771389	36.910.927,54
NTN-F - 01/01/2029	16/08/2018	Curva - Taxa: 11,6000%	14.670	985,980355	14.464.331,81

Investimentos


\$ 807.110.370,56

Disponibilidades Financeiras

\$ 203.761,81

Total Carteira

\$ 807.314.132,37

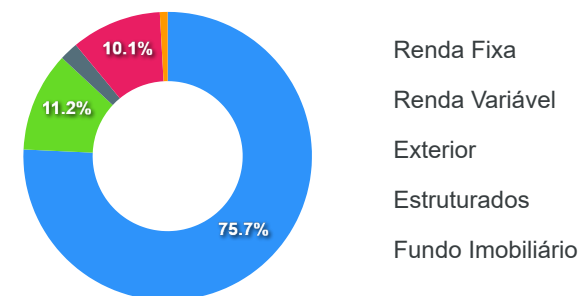
Governança (Pró Gestão)
 NIVEL 2 20/09/2026

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	31,88%	257.315.405,52 68,12%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	8,78%	70.890.127,05 91,22%
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	13,53%	109.193.621,91 56,47%
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	11,93%	96.327.456,05 8,07%
7º V a - FIDC Cota Sênior	10,00%	0,08%	637.966,75 9,92%
7º V b - Fundos de RF - Crédito Privado	10,00%	9,53%	76.928.266,29 0,47%
8º I - Fundos de Ações	40,00%	11,19%	90.289.676,93 28,81%
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	1,33%	10.736.826,43 8,67%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	0,75%	6.063.569,99 9,25%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	4,81%	38.828.430,17 5,19%
10º II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	5,31%	42.869.298,56 -0,31%
11º - Fundos Imobiliários	10,00%	0,87%	7.029.724,91 9,13%

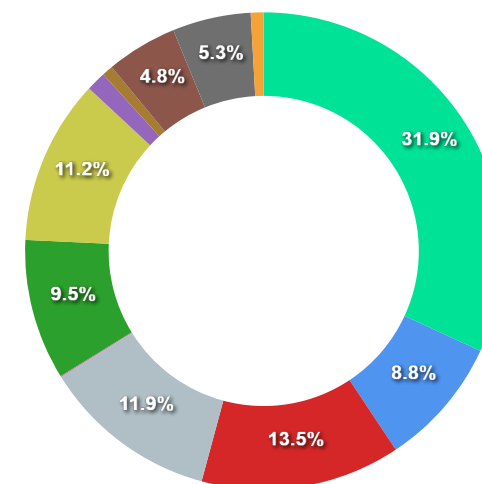
Governança (Pró Gestão)

NIVEL 2 20/09/2026

Segmentos



Artigos



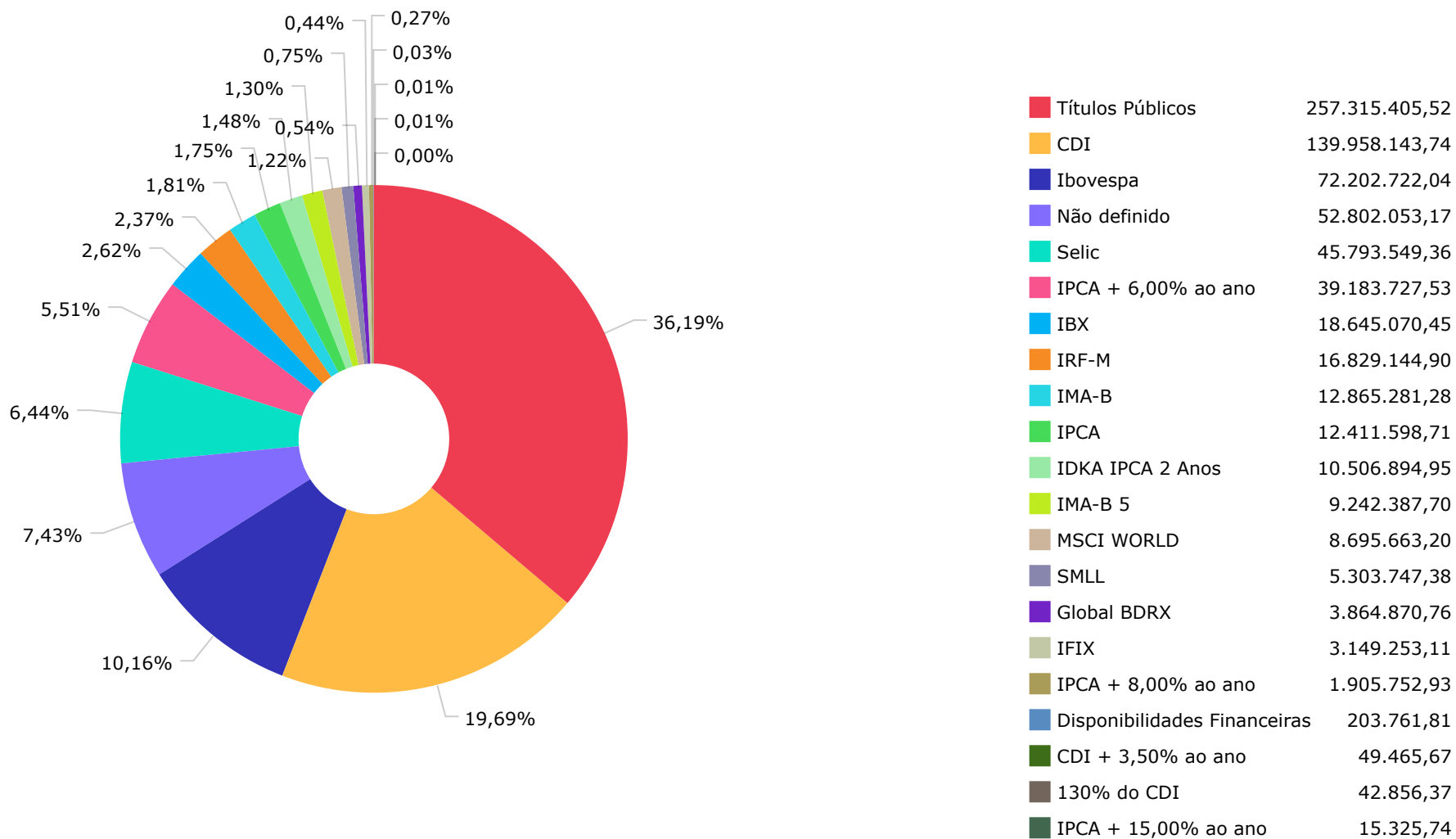
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	31,88%	0,00%	30,00%	100,00%	549.794.965,04	8° I - Fundos de Ações	11,19%	0,00%	19,00%	40,00%	232.554.471,29
7° I b - FI 100% Títulos TN	8,78%	0,00%	15,00%	100,00%	736.220.243,51	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	322.844.148,22
7° III a - FI Referenciados RF	13,53%	0,00%	7,00%	70,00%	455.783.637,48	9° II - Constituídos no Brasil	1,33%	0,00%	1,00%	10,00%	69.974.210,63
7° IV - Ativos Financeiros de ...	11,93%	0,00%	12,00%	20,00%	65.094.618,06	9° III - Ações - BDR Nível I	0,75%	0,00%	1,00%	10,00%	74.647.467,07
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,08%	0,00%	1,00%	10,00%	80.073.070,31	10° I - Fundos Multimercados	4,81%	0,00%	3,00%	10,00%	41.882.606,89
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	9,53%	0,00%	3,00%	10,00%	3.782.770,77	10° II - Fundos em Participaçõ...	5,31%	0,00%	5,00%	5,00%	-2.513.780,03
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	80.711.037,06	11° - Fundos Imobiliários	0,87%	0,00%	1,00%	5,00%	33.325.793,62

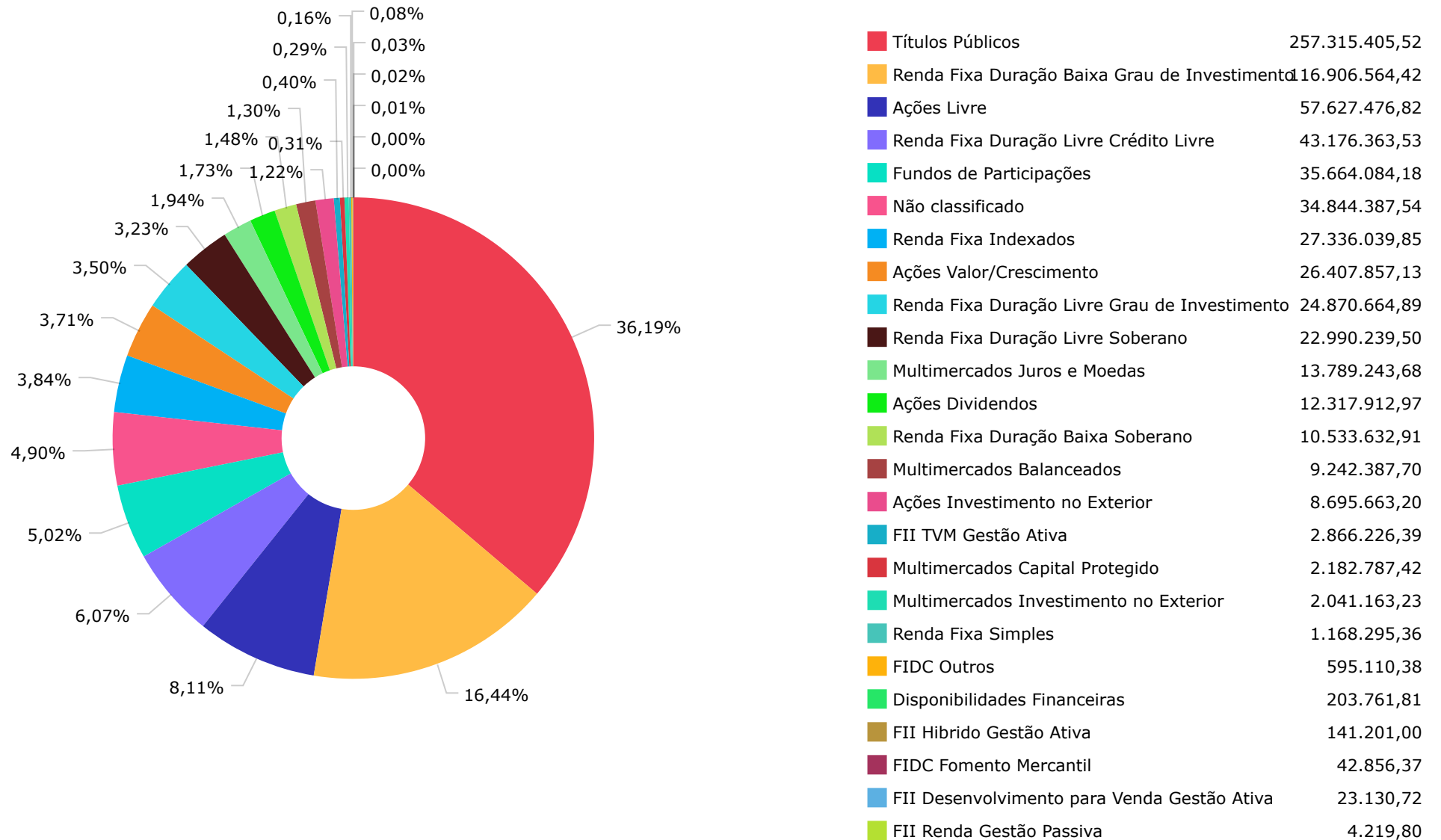
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
SANTANDER GLOBAIS REAIS BDR ETF FIC AÇÕES	-1,81	16,94	2,35	11,50	32,55	47,30	4,56	9,59
KÍNITRO FI AÇÕES	-0,38	10,40	2,95	9,63	23,34	18,85	4,10	8,64
CAIXA EXPERT PIMCO INCOME INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO LP	-1,44	6,78	1,14	6,14	14,99		1,21	2,54
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,92	10,23	2,83	5,90	12,53	28,25	0,09	0,18
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,96	1,76	7,89	12,24	-3,58			
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	0,89		2,01				0,85	1,80
KINEA AQUISIÇÕES RESIDENCIAIS RESP LIMITADA FII - KRES11								
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,89						0,85	1,79
CENESP FII - CNES11	-3,70		-13,33	-26,55			12,09	25,45
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,68						1,04	2,18
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO	-0,92						2,19	4,61
130% DO CDI - BENCHMARK								
	1,21	11,84	3,46	6,90	14,48	34,80		
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7								
CDI - BENCHMARK								
	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87		
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,97	11,14	2,90	6,03	13,63	28,67	0,05	0,10
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,85	10,38	2,90	5,94	12,71	26,01	0,10	0,21
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,95	9,75	2,81	5,63	12,01	27,92	0,01	0,02
MAG CASH FI RENDA FIXA LP	0,90	9,46	2,75	5,53	11,61	26,82	0,27	0,57
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,92	9,38	2,73	5,41	11,45	26,69	0,03	0,07
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,93	8,98	2,66	5,27	10,95	25,75	0,03	0,06
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,35	6,31	1,37	4,03	10,44	22,63	1,31	2,75
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,85	8,10	2,40	4,75	9,90	23,39	0,03	0,06
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,49	-2,44	-1,28	-2,54	-7,57	-6,66	0,15	0,32

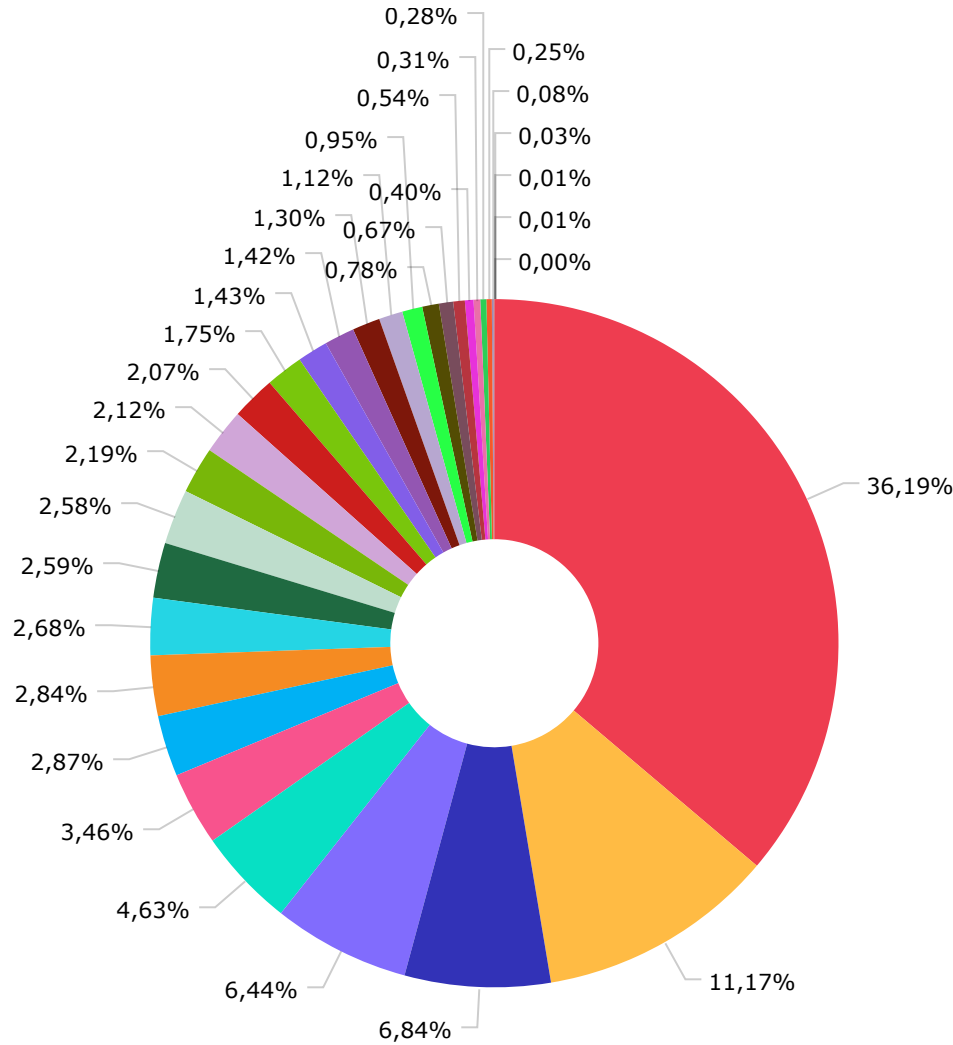
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI + 3,50% AO ANO - BENCHMARK	1,25	12,21	3,54	7,10	14,86	34,83		
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-3,98	-8,88	-6,63	-6,55	-16,63	144,53		
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	5,04	-2,37	-21,67	5,70	-21,97	325,64		
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	6,02	50,50	6,38	29,14	64,77	95,02		
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,42	46,01	7,20	28,10	63,31	93,92	7,37	15,53
IBOVESPA - BENCHMARK	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79		
TARPON GT INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,56	3,28	4,54	3,20	22,54	37,01	7,35	15,48
SANTANDER DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,53	2,98	4,15	6,80	21,89	28,52	4,31	9,08
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FI AÇÕES	-1,33	-0,80	3,40	3,55	17,93	16,83	5,63	11,86
VINCI TOTAL RETURN INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-1,41	-2,23	0,35	4,30	13,10	12,20	3,69	7,78
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	0,93	-5,32	1,89	1,31	12,32	12,33	5,19	10,93
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	-1,44	-5,73	1,57	3,85	11,96	4,01	4,42	9,32
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	-0,32	2,46	1,85	3,62	11,68		2,52	5,31
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	-0,45	2,59	1,60	3,28	10,82	14,07	2,55	5,37
OCCAM FI AÇÕES	-1,54	-5,89	-0,17	0,86	9,23	0,46	3,94	8,29
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,78	-7,80	-1,97	0,70	6,58	8,25	4,50	9,47
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-1,28	-19,94	-1,87	-7,32	-2,14	1,32	7,70	16,21
IBX - BENCHMARK	-1,53	-2,74	1,84	2,99	15,29	11,28		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FI AÇÕES	0,03	1,40	1,58	4,20	17,86	3,51	4,06	8,54
CLARITAS VALOR FEEDER FI AÇÕES	-1,66	-3,41	-1,40	0,48	13,23	2,45	4,74	9,99
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,81	5,86	1,81	3,85	9,37	19,24		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81	5,91	1,93	4,06	9,33	18,99	0,86	1,82

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B - BENCHMARK	-0,65	0,16	-0,80	1,63	5,62	15,10		
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,47	-4,86	-3,09	-0,74	-0,04	3,27	1,78	3,74
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,74	6,08	1,74	4,16	9,57	19,66		
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	0,57	6,13	2,58	6,45	15,14	30,03	2,27	4,77
IPCA - BENCHMARK	0,56	3,88	0,98	2,05	4,76	9,81		
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,32	5,67	1,41	4,36	8,52	19,28	1,25	2,63
IPCA + 15,00% AO ANO - BENCHMARK	1,85	16,91	4,57	9,43	20,47	45,22		
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	-5,78	-46,10	-15,01	-25,85	-48,88	-74,38	0,04	0,08
IPCA + 8,00% AO ANO - BENCHMARK	1,27	10,87	2,94	6,05	13,14	28,08		
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-0,21	-19,54	-41,19	-25,35	-19,10	-16,86	0,01	0,01
IRF-M - BENCHMARK	0,21	4,12	1,21	2,94	8,27	22,29		
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	0,83	7,92	2,41	4,78	9,92	24,55	0,15	0,31
SELIC - BENCHMARK	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,93	9,68	2,75	5,56	11,80	27,41	0,02	0,05
SMLL - BENCHMARK	-1,37	-14,85	-1,46	-3,76	2,51	-14,14		
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,13	0,81	0,60	3,01	16,47	2,73	1,90	4,01
IPCA + 6,00% AO ANO - BENCHMARK	1,10	9,13	2,46	5,06	11,04	23,38		
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA		12,83	0,26	6,10	11,49	2,34		
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	-1,53	0,96	-1,20	-1,72	2,37	-6,67		

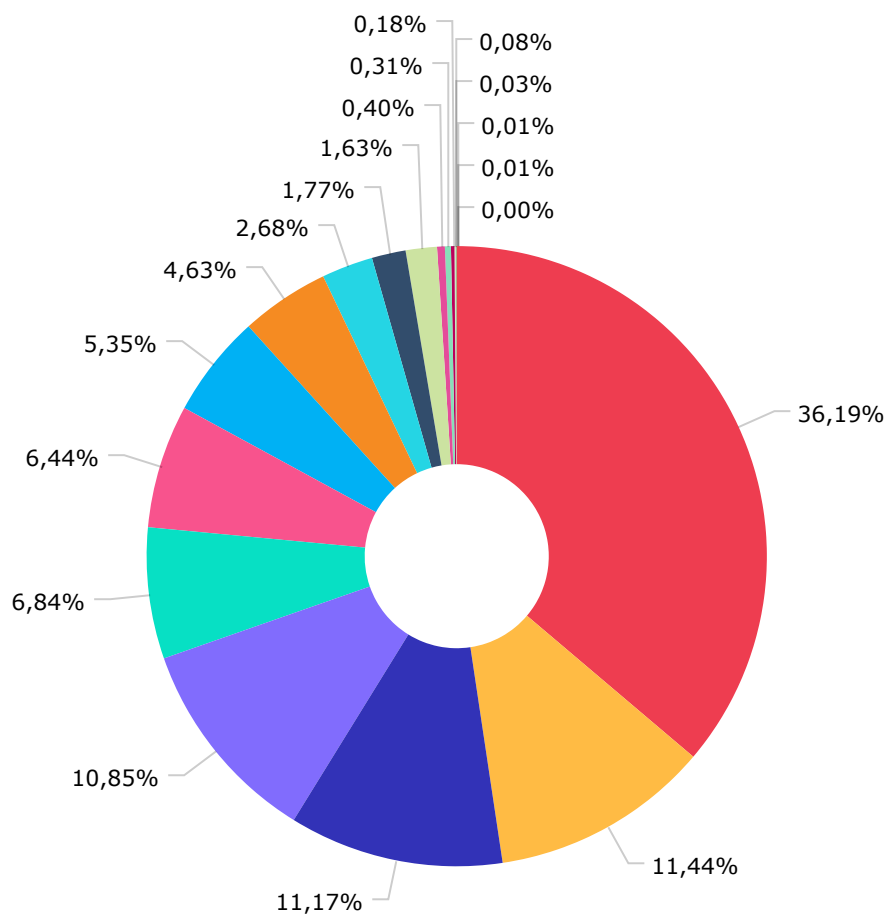
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,31	2,52	-0,66	-1,19	2,18	18,38		
NOVA RAPOSO FIP MULTIESTRATÉGIA - NVRP11	-0,10	-0,95	-0,29	-0,59	-9,33	1,28	0,00	0,00
MSCI WORLD - BENCHMARK	3,89	37,35	4,20	23,27	50,50	57,34		
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	12,19	39,34	22,21	34,63	78,36	66,45	9,21	19,40
IFIX - BENCHMARK	-3,06	-3,22	-4,75	-5,23	1,56	7,13		
BB VOTORANTIM ENERGIA SUSTENTÁVEL II FIP INFRAESTRUTURA - ESUD11	0,61	6,09	2,10	3,87	7,42	-81,62	0,26	0,55
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	-8,88	-26,64	-12,98	-21,48	-19,22	-34,64	7,19	15,14
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	-38,46	-41,46	-42,86	-41,46	-55,56	-75,00	75,97	160,00
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11							0,00	0,00







TESOURO NACIONAL	257.315.405,52
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	79.442.446,54
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	48.616.828,33
BANCO BRADESCO S.A.	45.793.549,36
CAIXA DTVM	32.891.225,95
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	24.602.123,83
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSO...	20.378.346,11
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	20.180.349,70
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT...	19.050.134,01
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	18.411.955,76
CLARITAS ADMINISTRAÇÃO DE RECU...	18.363.979,76
KINEA INVESTIMENTOS LTDA.	15.592.994,05
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	15.067.505,86
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	14.725.174,22
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	12.459.066,18
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS L...	10.168.896,14
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	10.071.043,22
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECU...	9.242.387,70
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	7.936.975,57
BAYES CAPITAL MANAGEMENT INVES...	6.755.658,49
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	5.559.417,02
VINCI GESTORA DE RECURSOS LTDA	4.757.285,59
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPA...	3.864.870,76
PLANNER CORRETORA DE VALORES S...	2.866.226,39
TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA	2.232.703,79
KINITRO CAPITAL GESTAO DE RECU...	1.997.960,28
ALASKA INVESTIMENTOS LTDA	1.800.437,63
PETRA CAPITAL GESTÃO DE INVEST...	545.644,71
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	203.761,81
VILA RICA CAPITAL GESTORA DE R...	47.943,32
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIR...	42.856,37
GENIAL GESTÃO LTDA	1.522,35



TESOURO NACIONAL	257.315.405,52
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	81.348.474,34
SANTANDER DISTRIBUIDORA DE TIT...	79.442.446,54
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	77.113.747,34
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	48.616.828,33
BANCO BRADESCO S.A.	45.793.549,36
INTRAG DTVM LTDA	38.060.493,72
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	32.891.225,95
ITAU UNIBANCO S.A.	19.050.134,01
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	12.560.533,96
LIONS TRUST ADMINISTRADORA DE ...	11.574.916,33
PLANNER TRUSTEE DTVM LTDA.	2.866.226,39
BANCO DAYCOVAL S.A.	2.232.703,79
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	1.278.262,18
FINAXIS CORRETORA DE TÍTULOS E...	545.644,71
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	203.761,81
BRL TRUST DISTRIBUIDORA DE TÍT...	47.943,32
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIR...	42.856,37
GENIAL INVESTIMENTOS CORRETORA...	1.522,35

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	802.124.090,31	10.388.389,46	40.697.407,85	1,31% ▲	5,42%	0,30%	6,37%	85,09%	1,60%
Setembro	802.124.090,31	51.142.691,06	51.159.929,20	802.296.821,08	189.968,91	40.887.376,76	0,02% ▲	5,44%	0,91%	7,33%	74,22%	1,12%
Outubro	802.296.821,08	93.978.475,60	93.814.238,15	807.110.370,56	4.649.312,03	45.536.688,79	0,58% ▲	6,05%	1,08%	8,49%	71,26%	0,83%

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%
3º Trim	21.340.519,60	2,74%	1,95%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

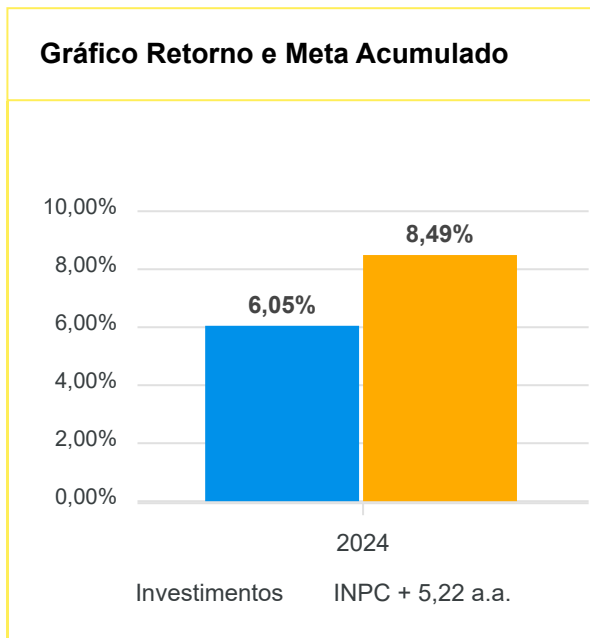


Gráfico Risco x Retorno

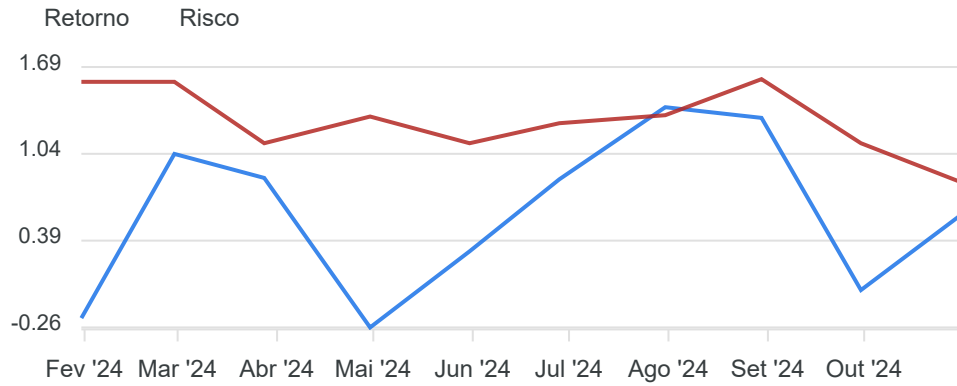
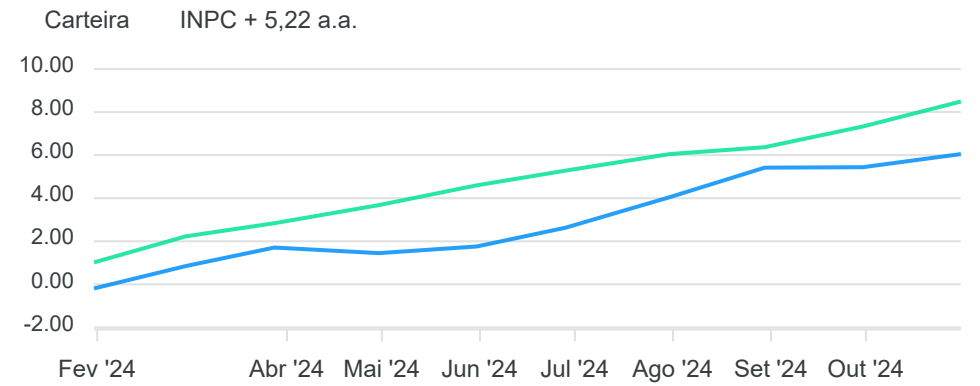
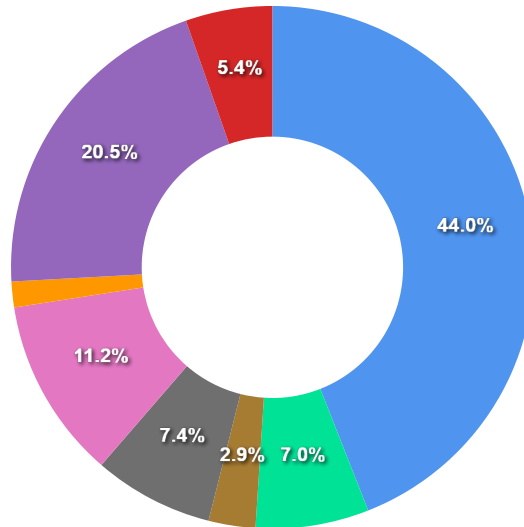


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/10/2024

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	355.482.186,95	44,03
Até D+180	56.577.144,17	7,01
Até D+360	23.388.051,38	2,90
Até D+720	59.899.699,56	7,42
Até D+1800	90.343.738,65	11,19
Até D+3600	12.865.281,28	1,59
Acima D+3600	165.523.738,27	20,50
Indeterminado	43.331.775,84	5,37



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	235.378.908,90	19.998.059,74	0,00	257.315.405,52	1.938.436,88	0,76% ▲	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	926.359,10	33.710.276,59	33.520.177,18	1.168.295,36	51.836,85	0,15% ▲	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.422.607,73	0,00	0,00	10.506.894,95	84.287,22	0,81% ▲	0,86%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	12.372.077,20	0,00	0,00	12.411.598,71	39.521,51	0,32% ▲	1,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.139.032,38	10.500.000,00	8.190.000,00	10.533.632,91	84.600,53	0,45% ▲	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	9.941.735,93	0,00	0,00	10.030.214,79	88.478,86	0,89% ▲	0,85%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	45.372.660,39	0,00	0,00	45.793.549,36	420.888,97	0,93% ▲	0,02%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	10.043.939,79	10.000.000,00	0,00	20.180.349,70	136.409,91	0,68% ▲	0,05%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.925.771,01	0,00	0,00	12.865.281,28	-60.489,73	-0,47% ▼	1,78%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	5.031.649,23	0,00	0,00	5.076.440,93	44.791,70	0,89% ▲	0,85%
CAIXA BRASIL ESPECIAL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	5.014.623,90	0,00	0,00	5.048.517,29	33.893,39	0,68% ▲	1,04%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	3.013.561,97	0,00	3.006.174,68	0,00	-7.387,29	-0,25% ▼	1,45%
CLARITAS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	12.710.704,45	0,00	0,00	12.827.117,69	116.413,24	0,92% ▲	0,09%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	49.929,42	0,00	0,00	47.943,32	-1.986,10	-3,98% ▼	-
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	33.789.666,22	0,00	15.000.000,00	19.050.134,01	260.467,79	0,77% ▲	0,01%
LETRA FINANCEIRA BTG	28.256.974,35	0,00	0,00	28.374.361,12	117.386,77	0,42% ▲	-
LF BTG 18/05/2026 IPCA + 6,10%	17.078.486,71	0,00	0,00	17.260.370,31	181.883,60	1,06% ▲	-
LF BTG 19/03/2029 IPCA + 6,43%	10.527.491,68	0,00	0,00	10.641.925,77	114.434,09	1,09% ▲	-
LF BTG 26/05/2025 IPCA + 6,93%	6.655.641,50	0,00	0,00	6.728.950,00	73.308,50	1,10% ▲	-
LF SANTANDER 03/10/2025 IPCA + 6,05%	16.573.333,11	0,00	0,00	16.659.101,38	85.768,27	0,52% ▲	-
LF SANTANDER 05/10/2026 IPCA + 6,05%	16.576.960,51	0,00	0,00	16.662.747,47	85.786,96	0,52% ▲	-
MAG CASH FI RENDA FIXA LP	10.077.972,15	0,00	0,00	10.168.896,14	90.923,99	0,90% ▲	0,27%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1.449,30	0,00	0,00	1.522,35	73,05	5,04% ▲	-
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	43.541,48	0,00	0,00	42.856,37	-685,11	-1,57% ▼	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	548.317,06	0,00	0,00	545.644,71	-2.672,35	-0,49% ▼	0,15%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	10.735.495,45	0,00	10.775.192,27	0,00	39.696,82	0,37% ▲	0,33%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	40.876.514,17	10.775.192,27	0,00	52.062.881,05	411.174,61	0,80% ▲	0,03%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	16.690.559,82	0,00	0,00	16.829.144,90	138.585,08	0,83% ▲	0,15%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	12.354.037,50	0,00	0,00	12.459.066,18	105.028,68	0,85% ▲	0,10%
	592.130.002,41	84.983.528,60	70.491.544,13	611.292.843,57	4.670.856,69	0,77%	0,13%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1.823.700,10	0,00	0,00	1.800.437,63	-23.262,47	-1,28% ▼	7,70%
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	6.693.284,68	0,00	0,00	6.755.658,49	62.373,81	0,93% ▲	5,19%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	13.103.764,75	0,00	0,00	13.108.208,38	4.443,63	0,03% ▲	4,06%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.296.887,96	0,00	0,00	5.303.747,38	6.859,42	0,13% ▲	1,90%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	4.019.694,97	0,00	0,00	3.966.191,61	-53.503,36	-1,33% ▼	5,63%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	5.630.248,78	0,00	0,00	5.536.862,07	-93.386,71	-1,66% ▼	4,74%
OCCAM FIC AÇÕES	20.697.245,07	0,00	0,00	20.378.346,11	-318.898,96	-1,54% ▼	3,94%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	17.164.555,42	0,00	10.900.000,00	6.029.511,02	-235.044,40	-1,37% ▼	4,50%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.444.035,16	3.000.000,00	0,00	8.351.721,36	-92.313,80	-1,09% ▼	4,31%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	10.218.240,45	0,00	0,00	10.071.043,22	-147.197,23	-1,44% ▼	4,42%
SPX APACHE FIC AÇÕES	3.237.163,82	0,00	3.238.316,41	0,00	1.152,59	0,04% ▲	4,99%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.220.229,46	0,00	0,00	2.232.703,79	12.474,33	0,56% ▲	7,35%
VINCI TOTAL RETURN INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.825.473,07	0,00	0,00	4.757.285,59	-68.187,48	-1,41% ▼	3,69%
KÍNITRO FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.997.960,28	-2.039,72	-0,10% ▼	4,10%
-	100.374.523,69	5.000.000,00	14.138.316,41	90.289.676,93	-946.530,35	-0,94%	4,33%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB VOTORANTIM ENERGIA SUSTENTÁVEL II FIP INFRAESTRUTURA - ESUD11	117.976,85	0,00	0,00	118.695,00	718,15	0,61% ▲	0,26%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	20.954.462,00	0,00	23.333,92	20.889.827,00	-41.301,08	-0,20% ▼	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP MULTIESTRATÉGIA	1.661.745,27	0,00	0,00	1.645.797,36	-15.947,91	-0,96% ▼	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	16.266,78	0,00	0,00	15.325,74	-941,04	-5,79% ▼	0,04%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.909.753,94	0,00	0,00	1.905.752,93	-4.001,01	-0,21% ▼	0,01%
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	13.741.687,07	0,00	0,00	13.789.243,68	47.556,61	0,35% ▲	1,31%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	5.695.420,67	0,00	0,00	5.677.035,80	-18.384,87	-0,32% ▼	2,52%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	2.192.672,62	0,00	0,00	2.182.787,42	-9.885,20	-0,45% ▼	2,55%
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	9.190.187,29	0,00	0,00	9.242.387,70	52.200,41	0,57% ▲	2,27%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	11.754.803,74	0,00	203.761,81	11.574.916,33	23.874,40	0,20% ▲	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	5.557.184,08	0,00	0,00	5.559.417,02	2.232,94	0,04% ▲	-
NOVA RAPOSO FIP MULTIESTRATÉGIA - NVRP11	1.160.747,43	0,00	0,00	1.159.567,18	-1.180,25	-0,10% ▼	0,00%
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO II RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO	8.010.643,91	0,00	0,00	7.936.975,57	-73.668,34	-0,92% ▼	2,19%
-	81.963.551,65	0,00	227.095,73	81.697.728,73	-38.727,19	-0,05% ▼	0,93%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	154.964,04	0,00	1.623,00	141.201,00	-12.140,04	-7,83% ▼	7,19%
CENESP FII - CNES11	4.382,10	0,00	16,74	4.219,80	-145,56	-3,32% ▼	12,09%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	37.587,42	0,00	0,00	23.130,72	-14.456,70	-38,46% ▼	75,97%
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	2.870.899,77	0,00	0,00	2.866.226,39	-4.673,38	-0,16% ▼	0,00%
KINEA AQUISIÇÕES RESIDENCIAIS RESP LIMITADA FII - KRES11	0,00	3.994.947,00	0,00	3.994.947,00	0,00	0,00%	-
-	3.067.833,33	3.994.947,00	1.639,74	7.029.724,91	-31.415,68	-0,44%	0,93%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA EXPERT PIMCO INCOME INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO LP	2.071.013,18	0,00	0,00	2.041.163,23	-29.849,95	-1,44% ▼	1,21%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	7.750.787,69	0,00	0,00	8.695.663,20	944.875,51	12,19% ▲	9,21%
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	9.068.333,49	0,00	8.955.642,14	0,00	-112.691,35	-1,24% ▼	5,55%
SANTANDER GLOBAIS REAIS BDR ETF FIC AÇÕES	2.239.119,68	0,00	0,00	2.198.699,23	-40.420,45	-1,81% ▼	4,56%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.631.655,96	0,00	0,00	3.864.870,76	233.214,80	6,42% ▲	7,37%
	24.760.910,00	0,00	8.955.642,14	16.800.396,42	995.128,56	4,02%	5,51%

Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **ITU - SP** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Outubro/2024**, atestando os dados relativos à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

Aprovação do Conselho Fiscal

O Conselho Fiscal do **ITU - SP** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Outubro/2024** bem como o parecer do Comitê de Investimentos, que tratam do acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do **ITU - SP** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

