

# 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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 19.446.694,61 | 19,12%     | 6.153.638.080,30 | 0,32% | 7º I b   |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO              | 9.547.117,30  | 9,39%      | 4.976.909.586,20 | 0,19% | 7º I b   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO            | 11.358.467,51 | 11,17%     | 8.329.801.460,71 | 0,14% | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PRE... | 11.166.223,19 | 10,98%     | 3.640.087.521,46 | 0,31% | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 3.818.297,06  | 3,75%      | 1.281.838.623,25 | 0,30% | 7º I b   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 4.219.322,44  | 4,15%      | 931.084.539,64   | 0,45% | 7º I b   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                 | 5.487.001,11  | 5,39%      | 3.720.203.081,78 | 0,15% | 7º I b   |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                       | 21.854.781,50 | 21,49% ▲   | 3.861.447.255,05 | 0,57% | 7º III a |
| IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP                                         | 91.261,55     | 0,09%      | 1.192.341,49     | 7,65% | 7º III a |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP                 | 1.920.193,13  | 1,89%      | 2.178.673.563,05 | 0,09% | 7º III a |
| BB AGRO FIC AÇÕES                                                    | 531.405,23    | 0,52%      | 222.980.311,09   | 0,24% | 8º I     |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES                                      | 1.042.979,64  | 1,03%      | 810.531.909,31   | 0,13% | 8º I     |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES                                            | 2.645.808,70  | 2,60%      | 645.563.640,82   | 0,41% | 8º I     |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES                                        | 2.536.308,93  | 2,49%      | 1.096.030.531,90 | 0,23% | 8º I     |
| MAG BRASIL FI AÇÕES                                                  | 4.484.230,63  | 4,41%      | 293.738.622,05   | 1,53% | 8º I     |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL 1                                           | 721.086,73    | 0,71%      | 200.885.333,62   | 0,36% | 9º III   |
| AUSTRO MULTISECTORIAL FIP MULTIESTRATÉGIA                            | 313.717,32    | 0,31%      | 15.915.245,32    | 1,97% | 10º II   |
| IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA                           | 203.439,76    | 0,20%      | 4.968.298,73     | 4,09% | 10º II   |
| LSH FIP MULTIESTRATÉGIA                                              | 52.122,25     | 0,05%      | 107.255.945,79   | 0,05% | 10º II   |
| PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA                                             | 10.696,17     | 0,01%      | 3.603.184,97     | 0,30% | 10º II   |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11             | 254.400,00    | 0,25%      | 56.874.171,21    | 0,45% | 11º      |

## Investimentos

\$ 101.705.554,76

## Disponibilidades Financeiras

\$ 17.150,39

## Total Carteira

\$ 101.722.705,15

## Governança (Pró Gestão)

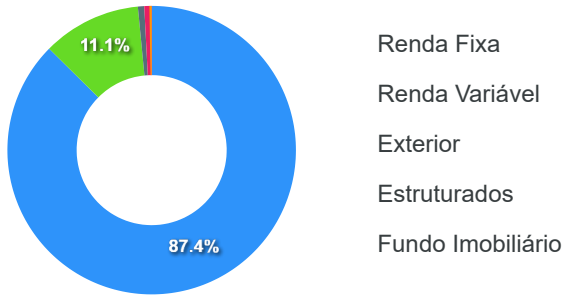
NIVEL 1 09/12/2025

| Artigos                                | Limite (%) | Utilizado |               | Livre  |               |
|----------------------------------------|------------|-----------|---------------|--------|---------------|
| 7º I b - FI 100% Títulos TN            | 100,00%    | 63,95%    | 65.043.123,22 | 36,05% | 36.662.431,54 |
| 7º III a - FI Referenciados RF         | 65,00%     | 23,47%    | 23.866.236,18 | 41,53% | 42.242.374,41 |
| 8º I - Fundos de Ações                 | 35,00%     | 11,05%    | 11.240.733,13 | 23,95% | 24.356.211,04 |
| 9º III - Ações - BDR Nível I           | 10,00%     | 0,71%     | 721.086,73    | 9,29%  | 9.449.468,75  |
| 10º II - Fundos em Participações (FIP) | 5,00%      | 0,57%     | 579.975,50    | 4,43%  | 4.505.302,24  |
| 11º - Fundos Imobiliários              | 5,00%      | 0,25%     | 254.400,00    | 4,75%  | 4.830.877,74  |

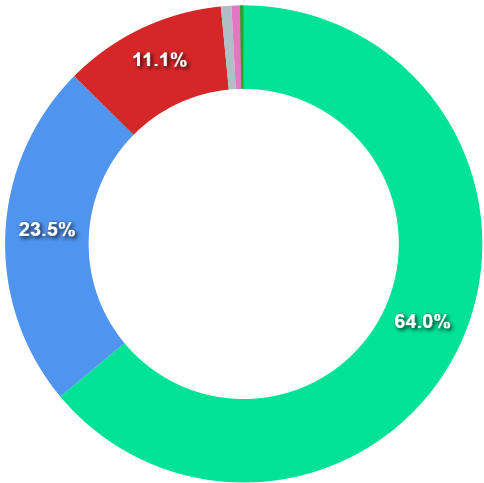
Governança (Pró Gestão)

🔗 NIVEL 1 09/12/2025

Segmentos



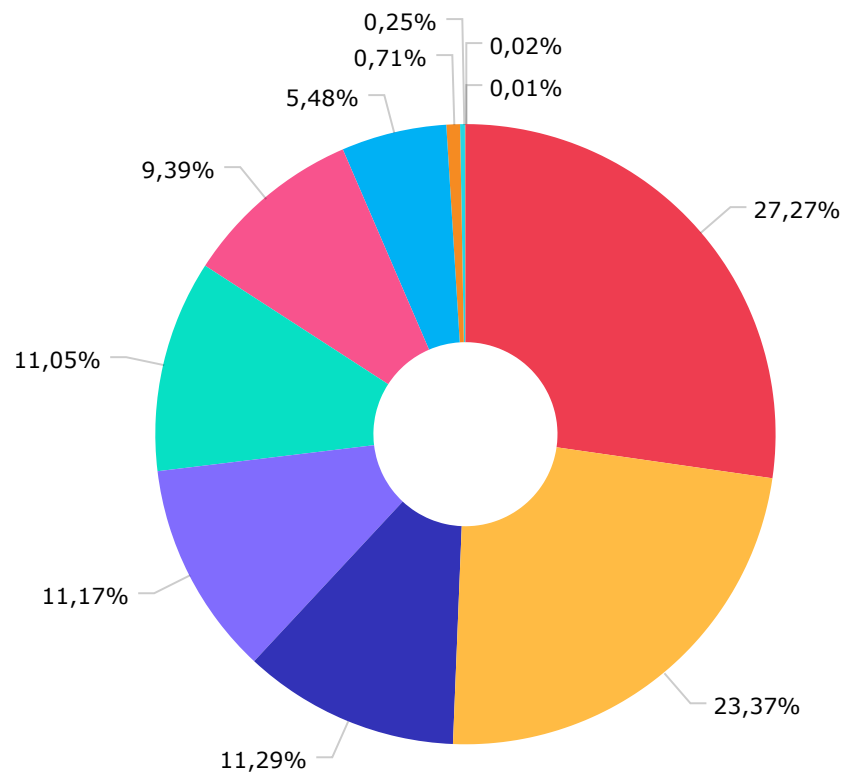
Artigos



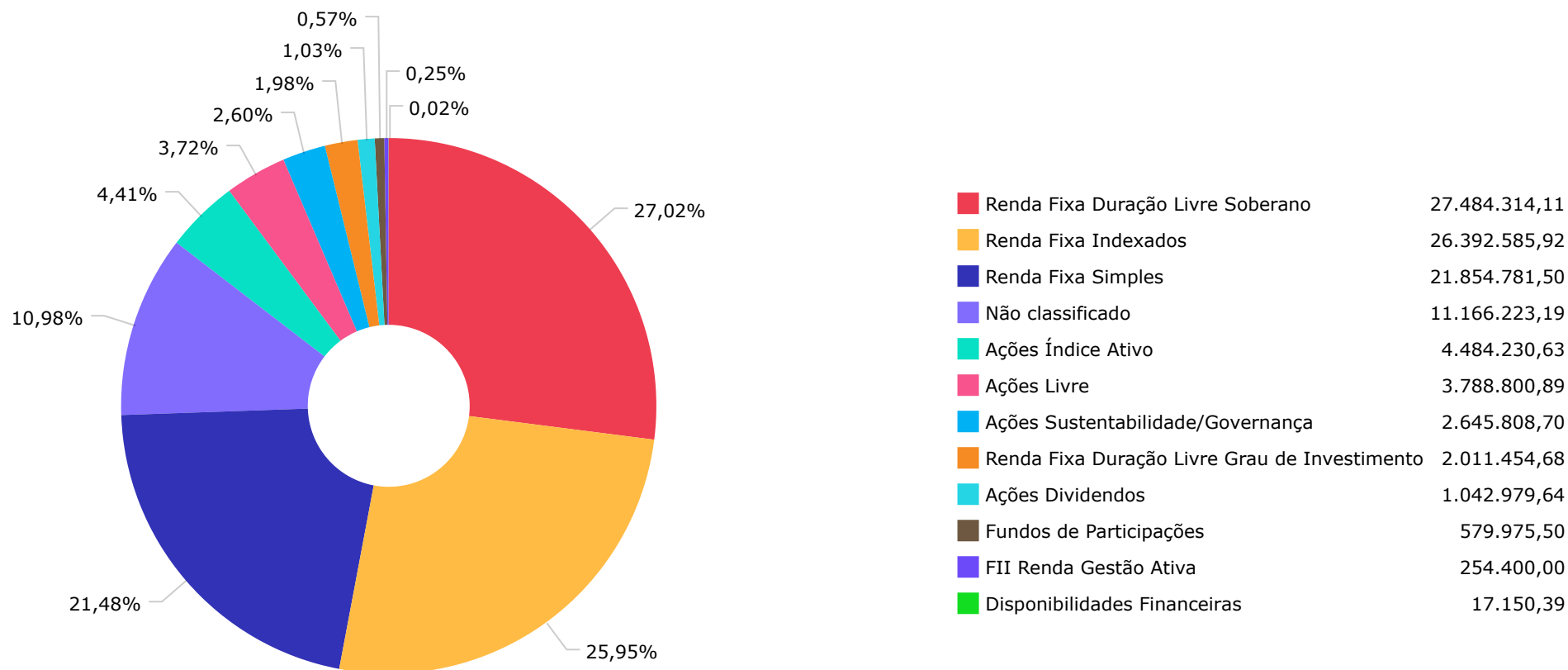
| Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo   | Superior | GAP Superior   | Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo   | Superior | GAP Superior  |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|----------------|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|---------------|
| 7º I a - Títulos TN SELIC         | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 100,00%  | 101.705.554,76 | 8º I - Fundos de Ações            | 11,05% | 0,00%    | 15,00% | 35,00%   | 24.356.211,04 |
| 7º I b - FI 100% Títulos TN       | 63,95% | 0,00%    | 63,00% | 100,00%  | 36.662.431,54  | 8º II - ETF de Ações              | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 35,00%   | 35.596.944,17 |
| 7º I c - ETF 100% Títulos TN      | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 100,00%  | 101.705.554,76 | 9º I - Renda Fixa - Dívida Ext... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 10,00%   | 10.170.555,48 |
| 7º II - Operações Compromissad... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 5.085.277,74   | 9º II - Constituídos no Brasil    | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 10,00%   | 10.170.555,48 |
| 7º III a - FI Referenciados RF    | 23,47% | 0,00%    | 15,00% | 65,00%   | 42.242.374,41  | 9º III - Ações - BDR Nível I      | 0,71%  | 0,00%    | 1,00%  | 10,00%   | 9.449.468,75  |
| 7º III b - FI de Índices Refer... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 65,00%   | 66.108.610,59  | 10º I - Fundos Multimercados      | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 10,00%   | 10.170.555,48 |
| 7º IV - Ativos Financeiros de ... | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 20,00%   | 20.341.110,95  | 10º II - Fundos em Participaçõ... | 0,57%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 4.505.302,24  |
| 7º V a - FIDC Cota Sênior         | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 5.085.277,74   | 10º III - Fundos de Ações - Me... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 5.085.277,74  |
| 7º V b - Fundos de RF - Crédit... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 5.085.277,74   | 11º - Fundos Imobiliários         | 0,25%  | 0,00%    | 1,00%  | 5,00%    | 4.830.877,74  |
| 7º V c - Fundos de Debentures ... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 5.085.277,74   | 12º - Empréstimos Consignados     | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 5,00%    | 5.085.277,74  |

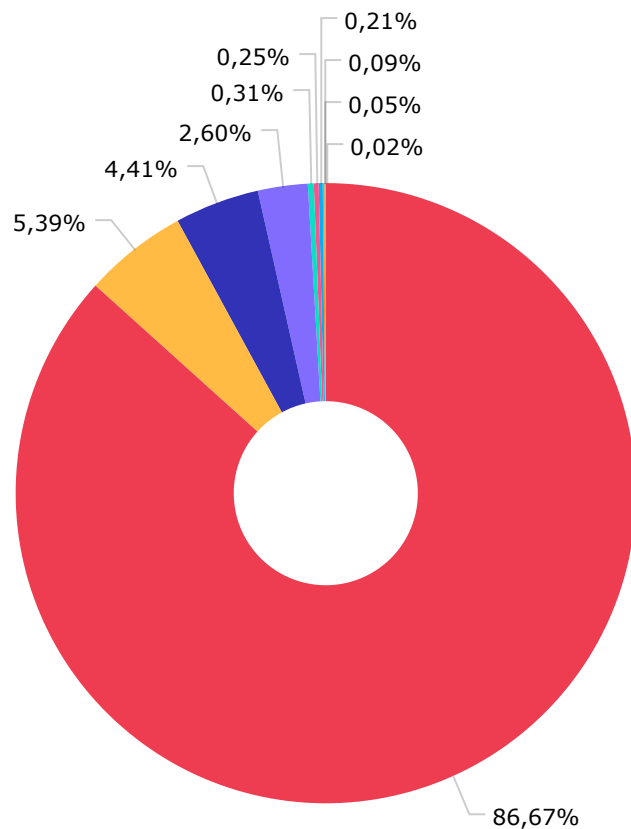
|                                                                                | Mês   | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M    | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|--------------------------------------------------------------------------------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|-----------|--------------------|
| <b>NÃO DEFINIDO - BENCHMARK</b>                                                |       |        |        |        |        |        |           |                    |
| AUSTRO MULTISSETORIAL FIP MULTISTRATÉGIA                                       | -0,17 | 19,23  | 20,81  | 20,15  | -75,57 | -75,97 |           |                    |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI... | 0,50  |        | 1,81   |        |        |        | 0,80      | 1,69               |
| <b>CDI - BENCHMARK</b>                                                         |       |        |        |        |        |        |           |                    |
|                                                                                | 0,83  | 7,99   | 2,63   | 5,23   | 11,06  | 25,98  |           |                    |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP                           | 1,06  | 8,02   | 2,77   | 5,84   | 11,35  | 24,95  | 0,50      | 1,06               |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                                 | 0,75  | 7,19   | 2,38   | 4,70   | 9,96   | 23,52  | 0,01      | 0,02               |
| <b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>                                                 |       |        |        |        |        |        |           |                    |
|                                                                                | -0,21 | 41,96  | 0,63   | 22,50  | 52,98  | 86,40  |           |                    |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL 1                                                     | -1,86 | 32,34  | 1,21   | 16,61  | 40,49  | 55,71  | 6,82      | 14,36              |
| <b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>                                                    |       |        |        |        |        |        |           |                    |
|                                                                                | -3,08 | -1,77  | 6,38   | 2,90   | 13,08  | 19,79  |           |                    |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES                                                      | -3,37 | -1,56  | 5,79   | 2,74   | 12,29  | 17,03  | 5,70      | 12,01              |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES                                                | -1,88 | 0,54   | 6,79   | -1,44  | 12,01  | 25,23  | 5,13      | 10,81              |
| MAG BRASIL FI AÇÕES                                                            | -3,26 | -3,16  | 5,87   | 1,23   | 10,13  | 7,86   | 5,53      | 11,64              |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES                                                  | -3,14 | -7,65  | 3,89   | -0,21  | 5,18   | 7,22   | 5,73      | 12,07              |
| BB AGRO FIC AÇÕES                                                              | -5,17 | -6,37  | -0,77  | -4,40  | 0,22   | 3,51   | 6,63      | 13,97              |
| <b>IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK</b>                                            |       |        |        |        |        |        |           |                    |
|                                                                                | 0,39  | 5,01   | 1,75   | 2,72   | 8,05   | 20,40  |           |                    |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                        | 0,48  | 5,06   | 1,89   | 2,95   | 8,09   | 20,22  | 0,82      | 1,72               |
| <b>IMA-B - BENCHMARK</b>                                                       |       |        |        |        |        |        |           |                    |
|                                                                                | -0,67 | 0,82   | 1,94   | 0,64   | 5,61   | 17,28  |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                           | -0,69 | 0,63   | 1,88   | 0,50   | 5,37   | 16,71  | 1,87      | 3,93               |
| IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP                                                   | -3,91 | -28,34 | -10,32 | -19,01 | -33,48 | -51,70 | 0,48      | 1,00               |
| <b>IPCA - BENCHMARK</b>                                                        |       |        |        |        |        |        |           |                    |
|                                                                                | 0,44  | 3,31   | 0,80   | 1,86   | 4,42   | 9,84   |           |                    |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                  | 0,71  | 6,65   | 2,71   | 4,15   | 9,77   | 24,69  | 0,18      | 0,37               |

|                                                               | Mês          | Ano          | 3M           | 6M           | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---------------------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,30         | 3,90         | 1,89         | 2,11         | 7,25         | 19,41        | 1,13      | 2,37               |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,56        | 1,03         | 1,88         | 0,78         | 5,27         | 16,89        | 2,07      | 4,36               |
| LSH FIP MULTIESTRATÉGIA                                       | -0,06        | -0,57        | -0,18        | -0,38        | -0,75        | -1,51        |           |                    |
| IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA                    | -0,30        | -10,93       | -0,86        | -1,70        | -12,33       | -18,47       |           |                    |
| <b>IPCA + 8,00% AO ANO - BENCHMARK</b>                        | <b>1,09</b>  | <b>9,48</b>  | <b>2,76</b>  | <b>5,86</b>  | <b>12,78</b> | <b>28,12</b> |           |                    |
| PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA                                      | -0,10        | -1,32        | -0,31        | -0,61        | -1,61        | -3,34        |           |                    |
| <b>IRF-M 1 - BENCHMARK</b>                                    | <b>0,82</b>  | <b>7,18</b>  | <b>2,55</b>  | <b>4,60</b>  | <b>10,28</b> | <b>25,21</b> |           |                    |
| 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               |
| <b>IFIX - BENCHMARK</b>                                       | <b>-2,58</b> | <b>-0,16</b> | <b>-1,24</b> | <b>-3,00</b> | <b>2,69</b>  | <b>10,54</b> |           |                    |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11      | -3,05        | 16,06        | -7,56        | -25,70       | -10,17       | -60,15       | 9,35      | 19,70              |

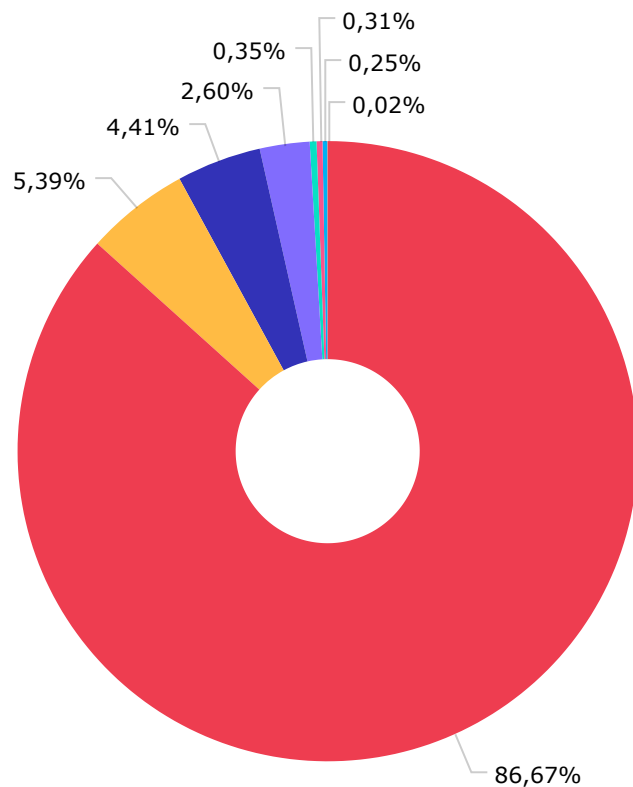


|                              |               |
|------------------------------|---------------|
| IPCA                         | 27.739.876,12 |
| CDI                          | 23.774.974,63 |
| Não definido                 | 11.479.940,51 |
| IRF-M 1                      | 11.358.467,51 |
| Ibovespa                     | 11.240.733,13 |
| IDKA IPCA 2 Anos             | 9.547.117,30  |
| IMA-B                        | 5.578.262,66  |
| Global BDRX                  | 721.086,73    |
| IFIX                         | 254.400,00    |
| Disponibilidades Financeiras | 17.150,39     |
| IPCA + 8,00% ao ano          | 10.696,17     |





|                                   |               |
|-----------------------------------|---------------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 88.167.406,11 |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 5.487.001,11  |
| MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS L... | 4.484.230,63  |
| ITAU UNIBANCO S.A.                | 2.641.279,86  |
| RENTA ASSET ADMINISTRADORA DE ... | 313.717,32    |
| ZION GESTÃO DE RECURSOS LTDA      | 254.400,00    |
| GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.       | 214.135,93    |
| VCM GESTÃO DE CAPITAL LTDA        | 91.261,55     |
| RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL... | 52.122,25     |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA        | 17.150,39     |



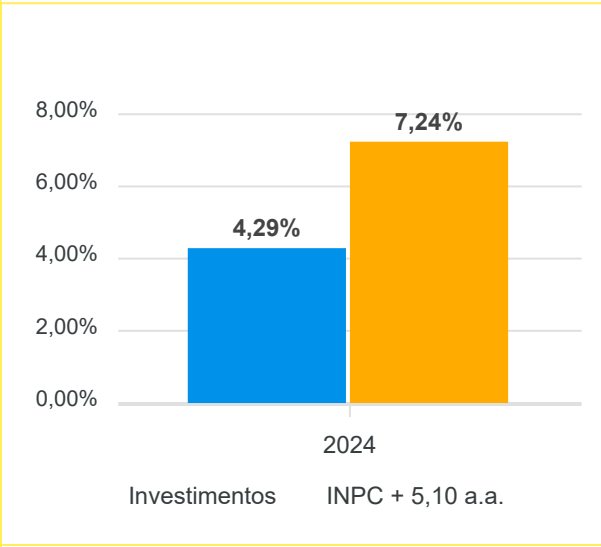
|                                   |               |
|-----------------------------------|---------------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 88.167.406,11 |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 5.487.001,11  |
| BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E... | 4.484.230,63  |
| ITAU UNIBANCO S.A.                | 2.641.279,86  |
| RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL... | 357.519,73    |
| BFL ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS ... | 313.717,32    |
| PLANNER CORRETORA DE VALORES S... | 254.400,00    |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA        | 17.150,39     |

| Mês       | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual    | Retorno \$   | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|--------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro   | 95.031.819,30  | 1.796.432,83  | 762.106,99    | 96.038.562,16  | -27.582,98   | -27.582,98           | -0,03% ▼  | -0,03%              | 1,01%  | 1,01%            | -2,97%                     | 1,19%       |
| Fevereiro | 96.038.562,16  | 1.740.808,57  | 2.019.531,97  | 96.410.437,03  | 650.598,27   | 623.015,29           | 0,68% ▲   | 0,65%               | 1,19%  | 2,21%            | 29,41%                     | 1,21%       |
| Março     | 96.410.437,03  | 1.149.614,15  | 804.906,52    | 97.277.474,81  | 522.330,15   | 1.145.345,44         | 0,54% ▲   | 1,19%               | 0,59%  | 2,81%            | 42,35%                     | 0,99%       |
| Abril     | 97.277.474,81  | 1.356.121,14  | 736.000,41    | 97.449.880,98  | -447.714,56  | 697.630,88           | -0,46% ▼  | 0,73%               | 0,81%  | 3,64%            | 20,05%                     | 1,41%       |
| Mai       | 97.449.880,98  | 1.226.310,31  | 856.723,09    | 98.325.029,44  | 505.561,24   | 1.203.192,12         | 0,52% ▲   | 1,25%               | 0,88%  | 4,55%            | 27,47%                     | 1,18%       |
| Junho     | 98.325.029,44  | 12.372.510,60 | 12.111.741,73 | 98.960.258,52  | 374.460,21   | 1.577.652,33         | 0,38% ▲   | 1,63%               | 0,65%  | 5,22%            | 31,23%                     | 1,57%       |
| Julho     | 98.960.258,52  | 1.132.788,51  | 762.464,57    | 100.671.537,23 | 1.340.954,77 | 2.918.607,10         | 1,35% ▲   | 3,01%               | 0,72%  | 5,98%            | 50,33%                     | 1,44%       |
| Agosto    | 100.671.537,23 | 21.047.725,69 | 21.768.090,64 | 101.263.767,65 | 1.312.595,37 | 4.231.202,47         | 1,30% ▲   | 4,35%               | 0,29%  | 6,29%            | 69,16%                     | 1,68%       |
| Setembro  | 101.263.767,65 | 19.967.736,85 | 19.463.580,97 | 101.705.554,76 | -62.368,77   | 4.168.833,70         | -0,06% ▼  | 4,29%               | 0,90%  | 7,24%            | 59,25%                     | 1,15%       |

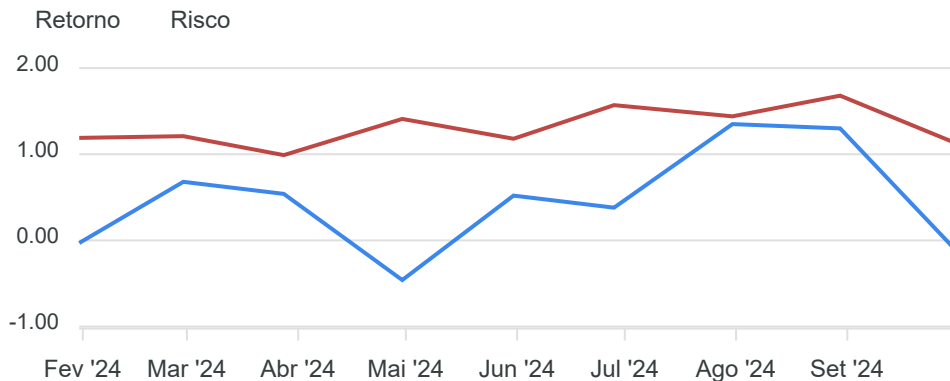
Retorno Acumulado (Períodos)

| Período | Retorno \$   | Retorno % | Meta % |
|---------|--------------|-----------|--------|
| 1º Trim | 1.145.345,44 | 1,19%     | 2,81%  |
| 2º Trim | 432.306,89   | 0,44%     | 2,35%  |
| 1º Sem  | 1.577.652,33 | 1,63%     | 5,22%  |
| 3º Trim | 2.591.181,37 | 2,61%     | 1,92%  |

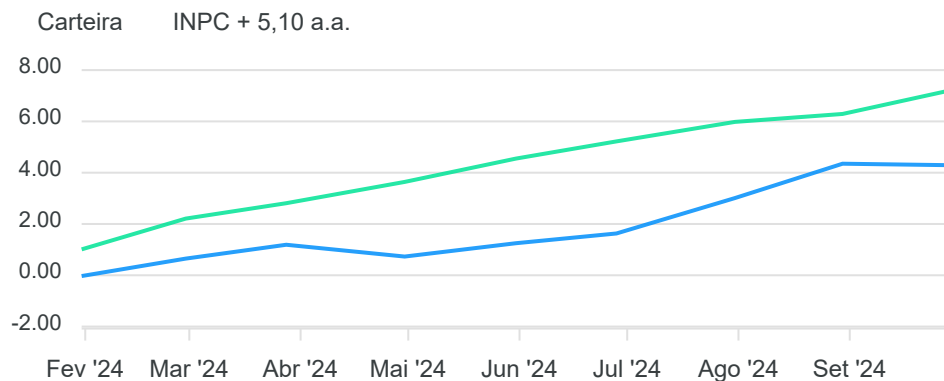
Gráfico Retorno e Meta Acumulado



**Gráfico Risco x Retorno**

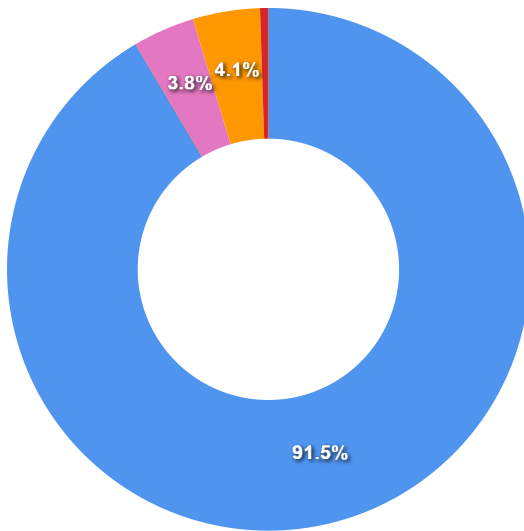


**Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade**



**Liquidez - 30/09/2024**

| Disponibilidade | Valor         | %     |
|-----------------|---------------|-------|
| Até D+30        | 93.073.165,92 | 91,51 |
| Até D+180       | 0,00          | 0,00  |
| Até D+360       | 0,00          | 0,00  |
| Até D+720       | 0,00          | 0,00  |
| Até D+1800      | 3.909.558,61  | 3,84  |
| Até D+3600      | 4.219.322,44  | 4,15  |
| Acima D+3600    | 0,00          | 0,00  |
| Indeterminado   | 520.658,18    | 0,51  |



| RENTA FIJA                                                                      | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual   | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---------------------------------------------------------------------------------|----------------|---------------|---------------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                   | 19.310.208,51  | 0,00          | 0,00          | 19.446.694,61 | 136.486,10 | 0,71% ▲   | 0,18%       |
| BB FLUXO FIC RENTA FIJA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                                  | 15.553.089,21  | 13.337.736,85 | 7.163.334,70  | 21.854.781,50 | 127.290,14 | 0,44% ▲   | 0,01%       |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                         | 9.501.745,47   | 0,00          | 0,00          | 9.547.117,30  | 45.371,83  | 0,48% ▲   | 0,82%       |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                       | 4.011.156,84   | 0,00          | 3.964.837,50  | 0,00          | -46.319,34 | -1,15% ▼  | 2,58%       |
| BB IMA-B FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                                           | 2.172.973,66   | 0,00          | 2.153.705,25  | 0,00          | -19.268,41 | -0,89% ▼  | 1,86%       |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                       | 5.182.993,09   | 6.130.000,00  | 0,00          | 11.358.467,51 | 45.474,42  | 0,40% ▲   | 0,14%       |
| BB IRF-M 1+ FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                                        | 2.134.441,53   | 0,00          | 2.138.023,18  | 0,00          | 3.581,65   | 0,17% ▲   | 1,97%       |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                          | 4.028.154,49   | 0,00          | 4.043.680,34  | 0,00          | 15.525,85  | 0,39% ▲   | 1,35%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO... | 11.111.023,04  | 0,00          | 0,00          | 11.166.223,19 | 55.200,15  | 0,50% ▲   | 0,80%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                   | 3.806.750,24   | 0,00          | 0,00          | 3.818.297,06  | 11.546,82  | 0,30% ▲   | 1,13%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                   | 4.242.905,55   | 0,00          | 0,00          | 4.219.322,44  | -23.583,11 | -0,56% ▼  | 2,07%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP                            | 5.525.014,86   | 0,00          | 0,00          | 5.487.001,11  | -38.013,75 | -0,69% ▼  | 1,87%       |
| IMA-B 1000 FIC RENTA FIJA LP                                                    | 94.975,91      | 0,00          | 0,00          | 91.261,55     | -3.714,36  | -3,91% ▼  | 0,48%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENTA FIJA LP                            | 1.899.997,31   | 0,00          | 0,00          | 1.920.193,13  | 20.195,82  | 1,06% ▲   | 0,50%       |
|                                                                                 | 88.575.429,71  | 19.467.736,85 | 19.463.580,97 | 88.909.359,40 | 329.773,81 | 0,37%     | 0,52%       |

| RENTA VARIÁVEL                  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$  | Retorno % | Risco - VaR |
|---------------------------------|----------------|------------|----------|---------------|-------------|-----------|-------------|
| BB AGRO FIC AÇÕES               | 560.385,48     | 0,00       | 0,00     | 531.405,23    | -28.980,25  | -5,17% ▼  | 6,63%       |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES | 557.575,37     | 500.000,00 | 0,00     | 1.042.979,64  | -14.595,73  | -1,38% ▼  | 5,13%       |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES       | 2.738.202,79   | 0,00       | 0,00     | 2.645.808,70  | -92.394,09  | -3,37% ▼  | 5,70%       |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES   | 2.618.648,96   | 0,00       | 0,00     | 2.536.308,93  | -82.340,03  | -3,14% ▼  | 5,73%       |
| MAG BRASIL FI AÇÕES             | 4.635.232,13   | 0,00       | 0,00     | 4.484.230,63  | -151.001,50 | -3,26% ▼  | 5,53%       |
| -                               | 11.110.044,73  | 500.000,00 | 0,00     | 11.240.733,13 | -369.311,60 | -3,18%    | 5,63%       |

| ESTRUTURADOS                               | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|-------------|
| AUSTRO MULTISSETORIAL FIP MULTIESTRATÉGIA  | 314.251,79     | 0,00       | 0,00     | 313.717,32  | -534,47    | -0,17% ▼  | -           |
| IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA | 204.045,89     | 0,00       | 0,00     | 203.439,76  | -606,13    | -0,30% ▼  | -           |
| LSH FIP MULTIESTRATÉGIA                    | 52.154,09      | 0,00       | 0,00     | 52.122,25   | -31,84     | -0,06% ▼  | -           |
| PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA                   | 10.706,87      | 0,00       | 0,00     | 10.696,17   | -10,70     | -0,10% ▼  | -           |
| -                                          | 581.158,64     | 0,00       | 0,00     | 579.975,50  | -1.183,14  | -0,20%    | 0,00%       |

| FUNDOS IMOBILIÁRIOS                                      | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|----------------------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|-------------|
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11 | 262.400,00     | 0,00       | 0,00     | 254.400,00  | -8.000,00  | -3,05% ▼  | 9,35%       |
| -                                                        | 262.400,00     | 0,00       | 0,00     | 254.400,00  | -8.000,00  | -3,05%    | 9,35%       |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|----------------------------|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|-------------|
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL 1 | 734.734,57     | 0,00       | 0,00     | 721.086,73  | -13.647,84 | -1,86% ▼  | 6,82%       |
|                            | 734.734,57     | 0,00       | 0,00     | 721.086,73  | -13.647,84 | -1,86%    | 0,00%       |

| RENTA FIJA                                                                      | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual   | Retorno \$   | Retorno % |
|---------------------------------------------------------------------------------|----------------|---------------|---------------|---------------|--------------|-----------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                   | 18.932.988,98  | 0,00          | 0,00          | 19.446.694,61 | 513.705,63   | 2,71% ▲   |
| BB FLUXO FIC RENTA FIJA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO                                  | 817.993,71     | 29.573.685,16 | 8.737.655,12  | 21.854.781,50 | 200.757,75   | 0,66% ▲   |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                         | 9.370.199,01   | 0,00          | 0,00          | 9.547.117,30  | 176.918,29   | 1,89% ▲   |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                       | 3.857.893,16   | 0,00          | 3.964.837,50  | 0,00          | 106.944,34   | 2,77% ▲   |
| BB IMA-B FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                                           | 2.120.231,06   | 0,00          | 2.153.705,25  | 0,00          | 33.474,19    | 1,58% ▲   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                       | 6.136.626,12   | 6.130.000,00  | 1.050.000,00  | 11.358.467,51 | 141.841,39   | 1,16% ▲   |
| BB IRF-M 1+ FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                                        | 2.089.824,60   | 0,00          | 2.138.023,18  | 0,00          | 48.198,58    | 2,31% ▲   |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                          | 3.949.938,72   | 0,00          | 4.043.680,34  | 0,00          | 93.741,62    | 2,37% ▲   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                   | 6.038.299,59   | 0,00          | 6.130.795,82  | 0,00          | 92.496,23    | 1,53% ▲   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO... | 5.244.462,85   | 5.944.565,89  | 153.743,35    | 11.166.223,19 | 130.937,80   | 1,17% ▲   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                   | 3.747.368,98   | 0,00          | 0,00          | 3.818.297,06  | 70.928,08    | 1,89% ▲   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                   | 4.263.186,29   | 0,00          | 126.207,80    | 4.219.322,44  | 82.343,95    | 1,93% ▲   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENTA FIJA PREVIDENCIÁRIO                            | 13.293.712,99  | 0,00          | 13.495.487,82 | 0,00          | 201.774,83   | 1,52% ▲   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENTA FIJA LP                            | 5.385.919,41   | 0,00          | 0,00          | 5.487.001,11  | 101.081,70   | 1,88% ▲   |
| IMA-B 1000 FIC RENTA FIJA LP                                                    | 101.764,77     | 0,00          | 0,00          | 91.261,55     | -10.503,22   | -10,32% ▼ |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENTA FIJA LP                            | 1.868.355,58   | 0,00          | 0,00          | 1.920.193,13  | 51.837,55    | 2,77% ▲   |
|                                                                                 | 87.218.765,82  | 41.648.251,05 | 41.994.136,18 | 88.909.359,40 | 2.036.478,71 | 2,33%     |

| RENTA VARIÁVEL                  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$ | Retorno % |
|---------------------------------|----------------|------------|----------|---------------|------------|-----------|
| BB AGRO FIC AÇÕES               | 535.503,86     | 0,00       | 0,00     | 531.405,23    | -4.098,63  | -0,77% ▼  |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES | 512.332,10     | 500.000,00 | 0,00     | 1.042.979,64  | 30.647,54  | 3,03% ▲   |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES       | 2.501.096,15   | 0,00       | 0,00     | 2.645.808,70  | 144.712,55 | 5,79% ▲   |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES   | 2.441.359,35   | 0,00       | 0,00     | 2.536.308,93  | 94.949,58  | 3,89% ▲   |
| MAG BRASIL FI AÇÕES             | 4.235.710,96   | 0,00       | 0,00     | 4.484.230,63  | 248.519,67 | 5,87% ▲   |
|                                 | 10.226.002,42  | 500.000,00 | 0,00     | 11.240.733,13 | 514.730,71 | 4,80%     |

| ESTRUTURADOS                               | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|--------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|
| AUSTRO MULTISSETORIAL FIP MULTIESTRATÉGIA  | 259.677,80     | 0,00       | 0,00     | 313.717,32  | 54.039,52  | 20,81% ▲  |
| IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA | 205.196,73     | 0,00       | 0,00     | 203.439,76  | -1.756,97  | -0,86% ▼  |
| LSH FIP MULTIESTRATÉGIA                    | 52.217,79      | 0,00       | 0,00     | 52.122,25   | -95,54     | -0,18% ▼  |
| PUMA FIP MULTIESTRATÉGIA                   | 10.729,84      | 0,00       | 0,00     | 10.696,17   | -33,67     | -0,31% ▼  |
|                                            | 527.822,16     | 0,00       | 0,00     | 579.975,50  | 52.153,34  | 9,88%     |

| FUNDOS IMOBILIÁRIOS                                      | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|----------------------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11 | 275.200,00     | 0,00       | 0,00     | 254.400,00  | -20.800,00 | -7,56% ▼  |
|                                                          | 275.200,00     | 0,00       | 0,00     | 254.400,00  | -20.800,00 | -7,56%    |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|----------------------------|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL 1 | 712.468,12     | 0,00       | 0,00     | 721.086,73  | 8.618,61   | 1,21% ▲   |
|                            | 712.468,12     | 0,00       | 0,00     | 721.086,73  | 8.618,61   | 1,21%     |

## 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

### Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **PREVIBARRAS PREVID SOCIAL DO MUNIC DE QUATRO BARRAS - PR** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Setembro/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 **PREVIBARRAS PREVID SOCIAL DO MUNIC DE QUATRO BARRAS - PR** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Setembro/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 **PREVIBARRAS PREVID SOCIAL DO MUNIC DE QUATRO BARRAS - PR** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

