

2023

Relatório

Mensal e 3º trimestre de 2023

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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.069.379,10	1,71%	6.063.437.379,24	0,08%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	32.152.105,45	10,83%	5.367.605.963,99	0,60%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	568.622,10	0,19%	188.464.404,15	0,30%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.140.910,44	2,74%	2.459.230.011,04	0,33%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.043.444,97	1,70%	22.537.730,94	22,38%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.121.956,45	8,12%	3.520.695.315,59	0,69%	7º I b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	35.174.821,81	11,84%	559.428.321,06	6,29%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.926.022,73	1,32%	5.412.384.350,74	0,07%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.023.780,19	2,70%	8.162.684.334,70	0,10%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	40.520.655,94	13,64%	5.222.821.325,49	0,78%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	305.256,52	0,10%	7.513.988.203,57	0,00%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.483.283,51	1,85%	460.466.276,94	1,19%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	25.989.995,32	8,75%	15.259.689.366,93	0,17%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	7.107.616,38	2,39%	569.383.114,96	1,25%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.885.977,51	4,00%	8.906.699.435,49	0,13%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.454.404,05	3,18%	14.368.447.188,06	0,07%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	16.843.964,81	5,67%	1.357.142.226,13	1,24%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.268.422,06	0,43%	1.247.653.218,33	0,10%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	900.038,18	0,30%	497.500.211,96	0,18%	8º I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	7.655.234,01	2,58%	762.055.294,68	1,00%	8º I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	10.145.883,47	3,42%	828.578.487,48	1,22%	8º I
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	15.718.025,99	5,29%	521.061.013,74	3,02%	8º I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.977.188,15	1,34%	640.753.823,10	0,62%	8º I
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1.204.260,71	0,41%	46.630.371,42	2,58%	8º I
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	3.232.842,84	1,09%	224.070.210,42	1,44%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.441.555,64	2,51%	446.292.351,73	1,67%	9º III
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.605.204,77	0,88%	114.052.283,92	2,28%	9º III

Investimentos

\$ 296.999.913,00

Disponibilidades Financeiras

\$ 299.716,22

Total Carteira

\$ 297.299.629,22

Governança (Pró Gestão)



Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.714.539,90	0,91%	1.999.422.357,55	0,14%	9º III
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	324.520,00	0,11%	184.281.000,00	0,18%	11º

Investimentos

\$ 296.999.913,00

Disponibilidades Financeiras

\$ 299.716,22

Total Carteira

\$ 297.299.629,22

Governança (Pró Gestão)

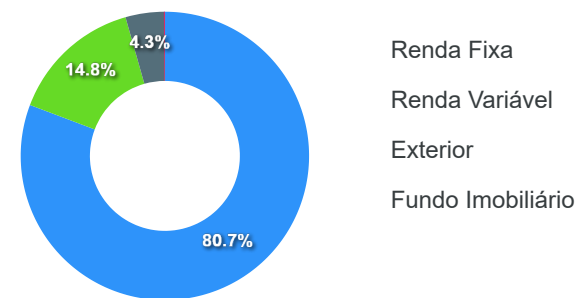


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	56,69% 168.530.239,21	43,31% 128.769.390,01
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	23,98% 71.281.958,07	36,02% 107.097.819,46
8º I - Fundos de Ações	30,00%	14,83% 44.101.895,41	15,17% 45.087.993,36
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	4,29% 12.761.300,31	5,71% 16.968.662,61
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,11% 324.520,00	4,89% 14.540.461,46

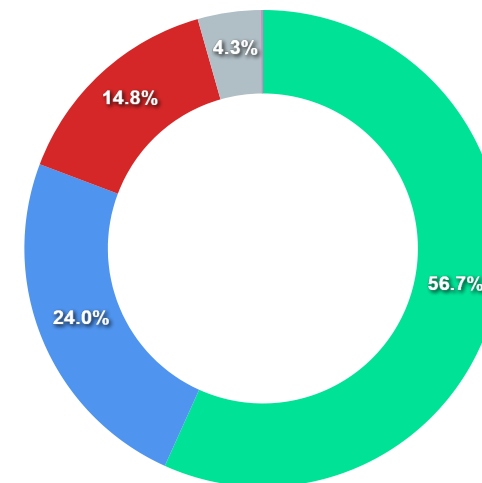
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



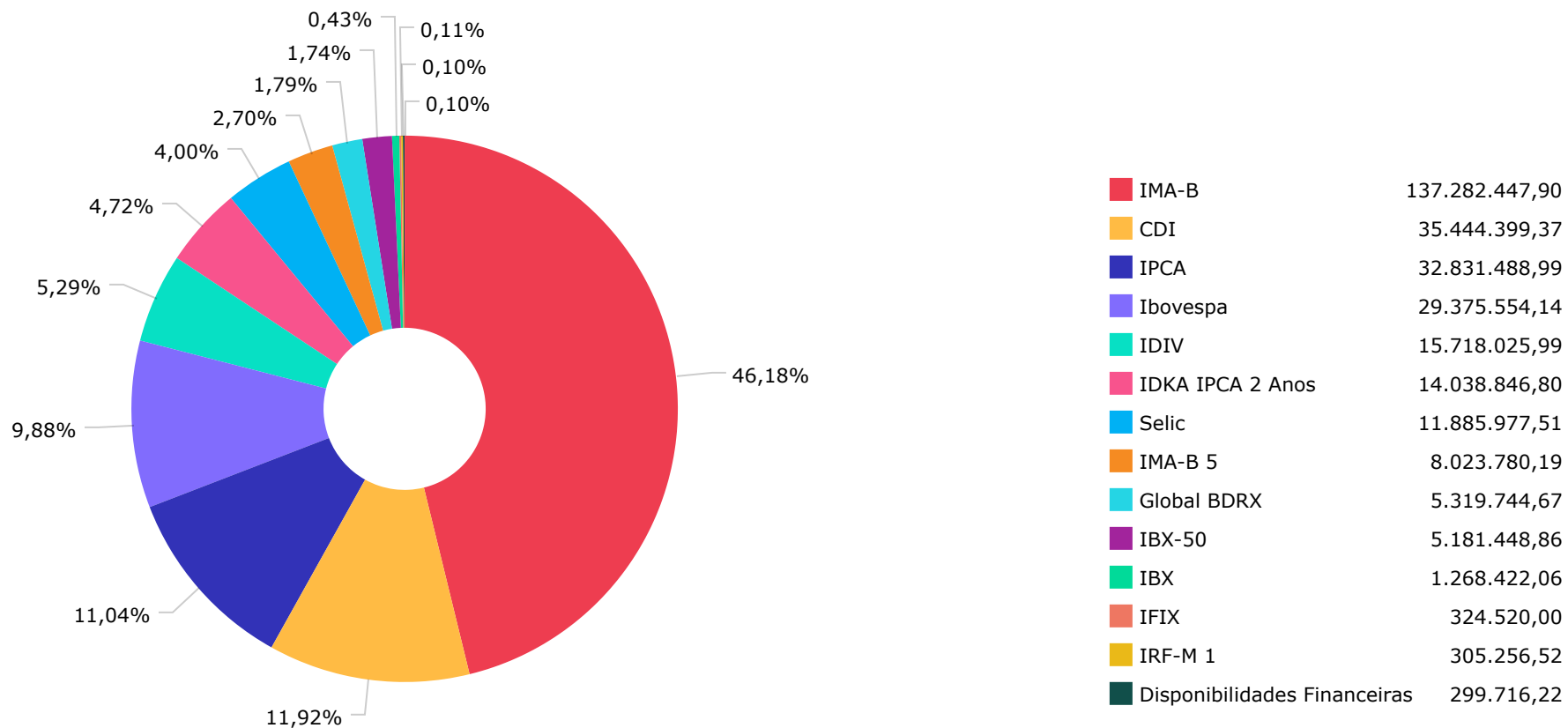
Artigos

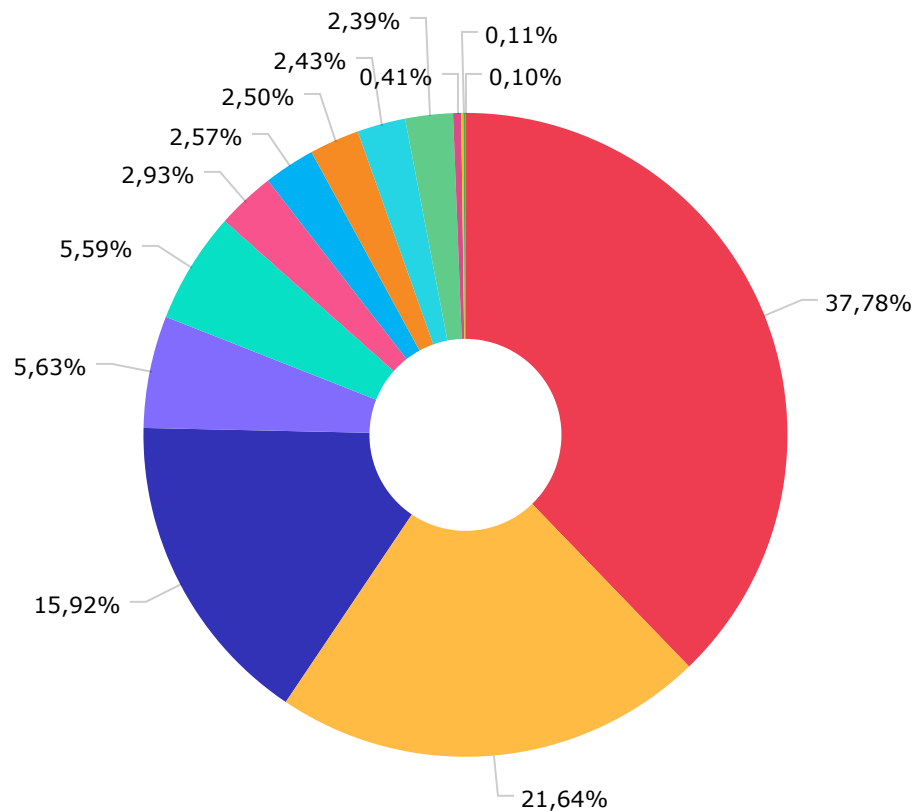


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	5,00%	100,00%	297.299.629,22	8° I - Fundos de Ações	14,83%	0,00%	16,00%	30,00%	45.087.993,36
7° I b - FI 100% Títulos TN	56,69%	0,00%	19,00%	100,00%	128.769.390,01	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	89.189.888,77
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	297.299.629,22	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	29.729.962,92
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	14.864.981,46	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	29.729.962,92
7° III a - FI Referenciados RF	23,98%	0,00%	50,00%	60,00%	107.097.819,46	9° III - Ações - BDR Nível I	4,29%	0,00%	4,00%	10,00%	16.968.662,61
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	178.379.777,53	10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	29.729.962,92
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	59.459.925,84	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	14.864.981,46
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	14.864.981,46	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	14.864.981,46
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	14.864.981,46	11° - Fundos Imobiliários	0,11%	0,00%	1,00%	5,00%	14.540.461,46
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	14.864.981,46	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	14.864.981,46

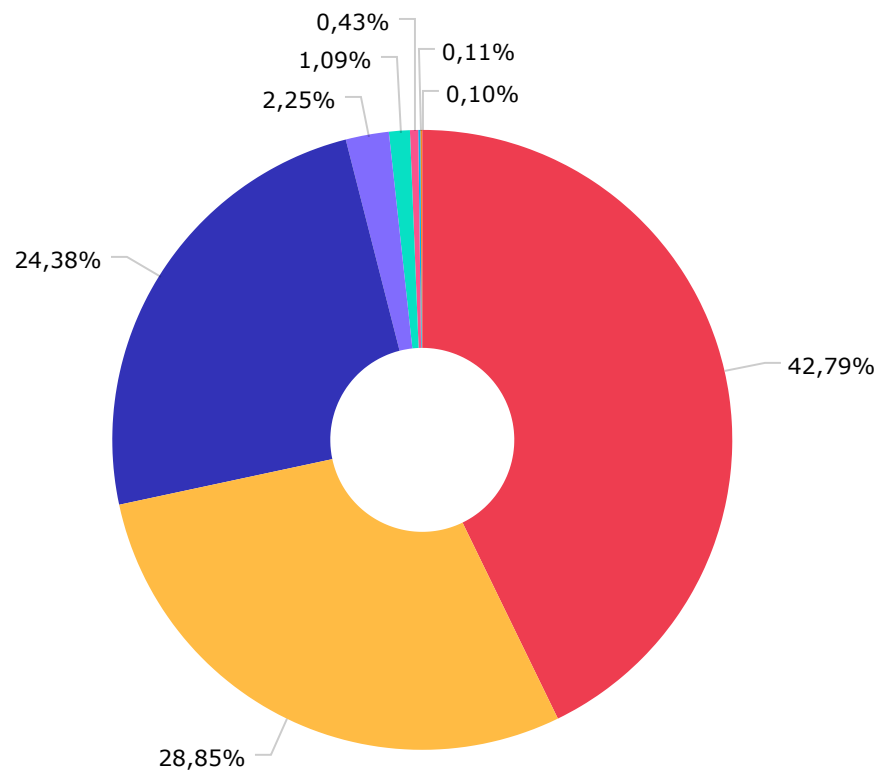
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03	10,09	3,44	6,80	13,67	26,38	0,01	0,03
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97	9,87	3,22	6,49	13,40	26,08	0,01	0,02
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	-3,46	17,23	1,81	7,82	21,85	-5,29		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,57	16,05	1,32	7,00	20,13	-7,28	4,97	10,47
BRASESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,41	7,63	1,13	4,47	11,45	-8,94	4,69	9,89
IBOVESPA - BENCHMARK	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03		
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,35	29,82	1,07	16,55	16,22	-16,75	6,92	14,57
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-0,29	14,58	-4,52	17,03	11,80	8,54	6,89	14,52
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	0,90	5,40	-1,05	14,24	4,22	1,06	7,77	16,37
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	-0,84	4,69	-3,14	12,18	2,76	7,54	7,29	15,36
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,87	3,35	0,58	10,91	-3,14	-16,56	8,29	17,45
IBX - BENCHMARK	0,84	5,50	-1,02	13,78	5,09	3,69		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,06	5,86	-3,41	11,98	2,07	-11,33	9,04	19,05
IBX-50 - BENCHMARK	1,21	4,92	-0,03	13,75	5,32	5,93		
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1,12	3,99	-0,41	13,03	4,24	3,38	9,85	20,74
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	0,94	3,70	-1,68	10,78	2,36	0,19	7,84	16,52
IDIV - BENCHMARK	1,32	10,67	1,25	15,38	14,16	22,39		
BRASESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,10	4,62	-2,05	12,35	4,98	12,91	7,42	15,62
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,29	8,97	2,05	4,08	11,42	21,35		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95	9,69	3,13	6,31	13,16	27,29	0,01	0,01

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36	8,79	2,06	4,24	11,36	20,79	0,74	1,55
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21	8,59	1,90	4,04	11,22	20,92	0,85	1,80
IMA-B - BENCHMARK	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09		
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,96	10,58	-0,57	6,43	10,77	18,51	2,53	5,33
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,96	10,65	-0,53	6,49	10,76	18,68	2,51	5,30
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,97	10,56	-0,64	6,42	10,75	18,44	2,52	5,32
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,97	10,54	-0,60	6,39	10,71	18,31	2,53	5,33
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,13	10,65	-0,74	6,40	10,68	18,20	2,57	5,42
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-1,00	10,71	-0,52	6,60	10,65	18,53	2,59	5,45
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,13	8,89	1,73	4,32	11,65	21,97		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,11	8,79	1,67	4,28	11,46	21,66	0,98	2,07
IPCA - BENCHMARK	0,39	3,64	0,75	1,51	5,33	12,88		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10	8,82	3,09	4,57	11,76		0,33	0,70
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09	8,79	3,08	4,56	11,73	22,62	0,33	0,70
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11		3,12				0,33	0,70
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,93	10,06	3,18	6,50	13,54	24,68		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91	9,91	3,12	6,37	13,31	24,16	0,07	0,15
SELIC - BENCHMARK	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05	10,30	3,54	6,88	13,98	27,19	0,03	0,07
IFIX - BENCHMARK	0,20	12,28	2,03	16,60	7,64	18,54		
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	-1,77	15,91	10,40	23,04	13,51	9,35	7,01	14,75

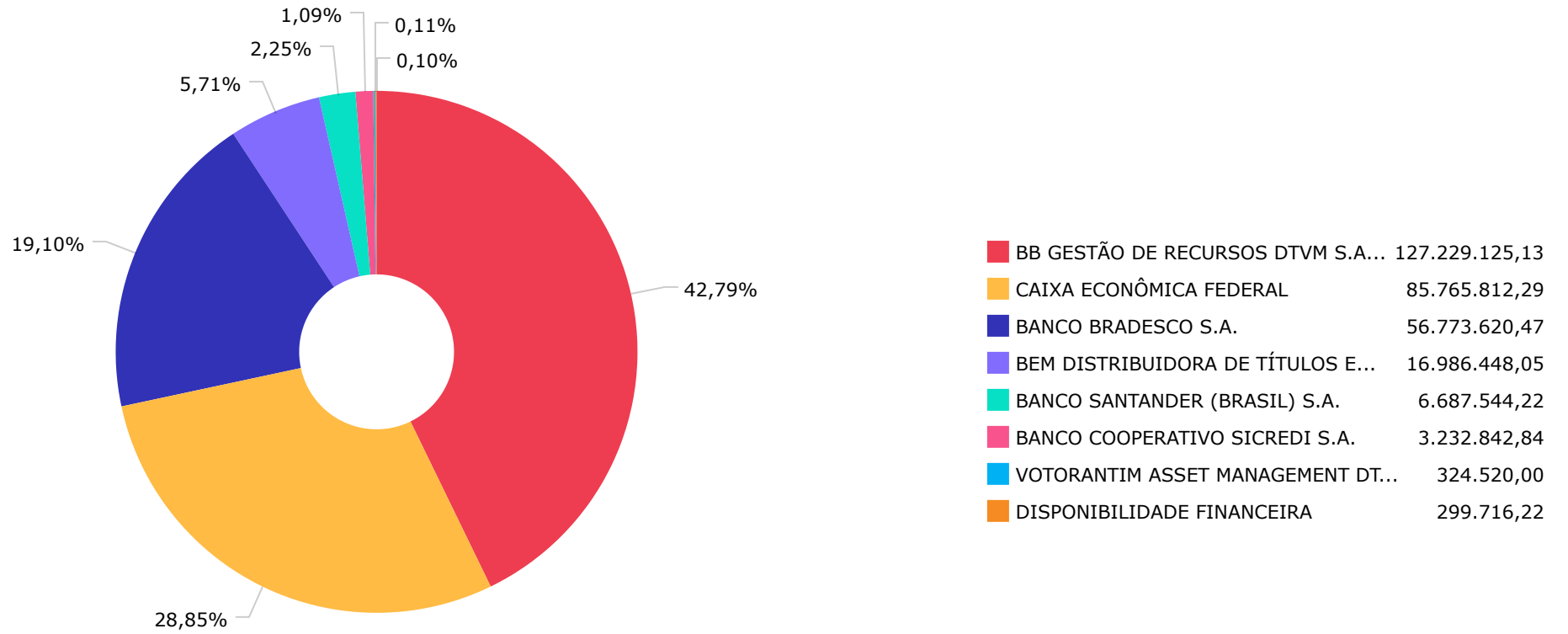




Renda Fixa Indexados	112.324.448,25
Renda Fixa Duração Livre Soberano	64.340.223,23
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	47.330.376,88
Ações Livre	16.734.050,20
Ações Dividendos	16.618.064,17
Não classificado	8.709.532,54
Ações Sustentabilidade/Governança	7.655.234,01
Ações Setoriais	7.441.555,64
Ações Índice Ativo	7.210.030,99
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	7.107.616,38
Ações Indexados	1.204.260,71
FII Renda Gestão Passiva	324.520,00
Disponibilidades Financeiras	299.716,22



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	127.229.125,13
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	85.765.812,29
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	72.491.646,46
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	6.687.544,22
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	3.232.842,84
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	1.268.422,06
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DT...	324.520,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	299.716,22



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	268.794.272,86	2.200.000,00	1.752.772,00	273.542.753,59	4.301.252,73	4.301.252,73	1,60% ▲	1,60%	0,97%	0,97%	164,95%	2,57%
Fevereiro	273.542.753,59	3.170.000,00	2.569.743,75	273.137.944,13	-1.005.065,71	3.296.187,02	-0,37% ▼	1,23%	1,20%	2,19%	56,16%	2,23%
Março	273.137.944,13	2.740.000,00	2.160.000,00	276.146.046,38	2.428.102,25	5.724.289,27	0,89% ▲	2,12%	1,17%	3,39%	62,54%	1,91%
Abril	276.146.046,38	2.800.000,00	2.170.000,00	279.837.694,10	3.061.647,72	8.785.936,99	1,11% ▲	3,25%	0,97%	4,39%	74,03%	2,00%
Mai	279.837.694,10	10.784.237,45	9.946.359,81	285.857.819,82	5.182.248,08	13.968.185,07	1,85% ▲	5,16%	0,67%	5,09%	101,38%	1,93%
Junho	285.857.819,82	76.182.559,80	75.843.475,21	293.709.583,12	7.512.678,71	21.480.863,78	2,63% ▲	7,92%	0,34%	5,45%	145,32%	2,47%
Julho	293.709.583,12	2.741.876,98	2.475.000,00	298.027.434,10	4.050.974,00	25.531.837,78	1,38% ▲	9,41%	0,54%	6,02%	156,31%	2,24%
Agosto	298.027.434,10	3.666.725,80	3.021.196,57	297.193.559,02	-1.479.404,31	24.052.433,47	-0,50% ▼	8,86%	0,69%	6,75%	131,26%	2,25%
Setembro	297.193.559,02	2.848.337,24	2.300.000,00	296.999.913,00	-741.983,26	23.310.450,21	-0,25% ▼	8,59%	0,79%	7,60%	113,03%	2,69%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	5.724.289,27	2,12%	3,39%
2º Trim	15.756.574,51	5,68%	2,00%
1º Sem	21.480.863,78	7,92%	5,45%
3º Trim	1.829.586,43	0,62%	2,04%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

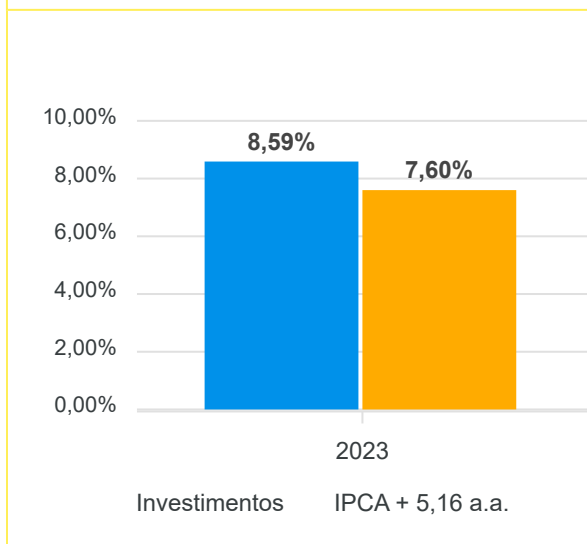


Gráfico Risco x Retorno

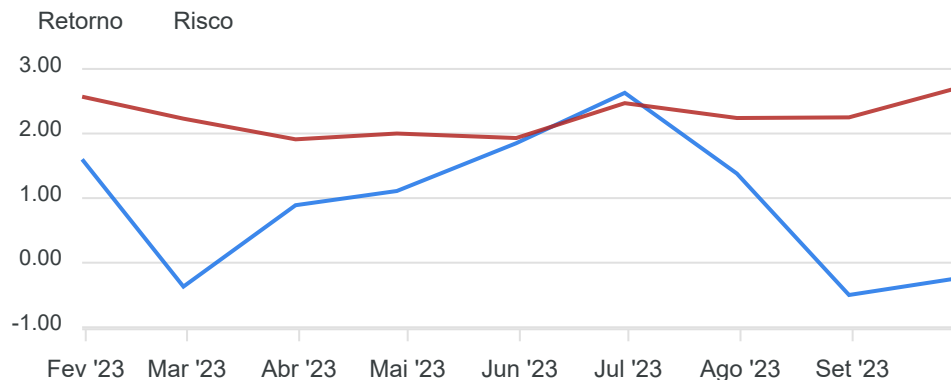
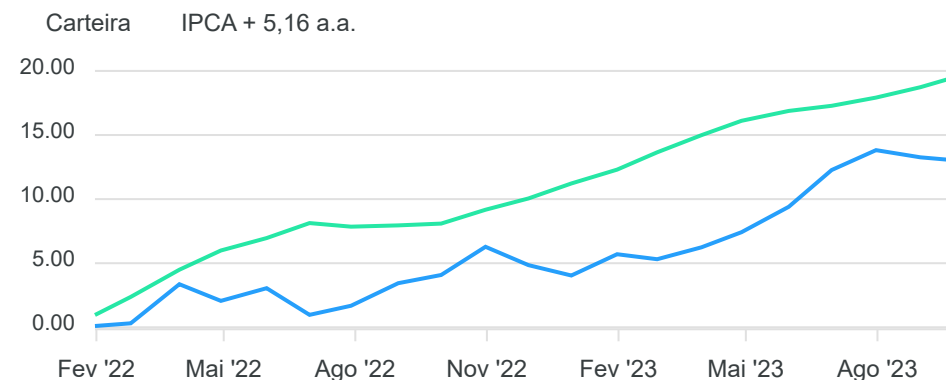
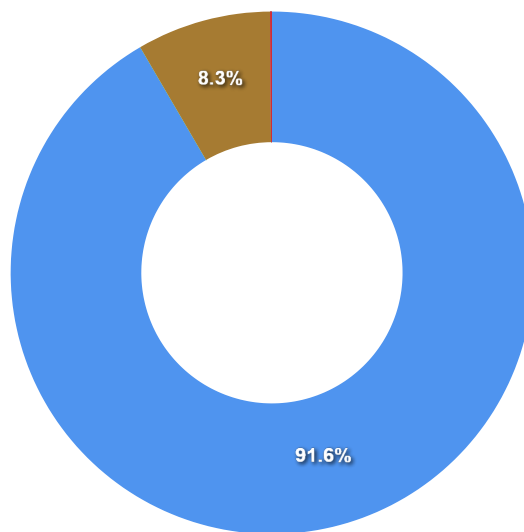


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 29/09/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	272.284.530,67	91,68
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	24.690.578,55	8,31
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	324.520,00	0,11



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.058.669,84	0,00	0,00	5.069.379,10	10.709,26	0,21% ▲	0,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	32.466.674,32	0,00	0,00	32.152.105,45	-314.568,87	-0,97% ▼	2,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	25.740.318,86	0,00	0,00	25.989.995,32	249.676,46	0,97% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	562.465,04	0,00	0,00	568.622,10	6.157,06	1,09% ▲	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.051.810,37	0,00	0,00	8.140.910,44	89.100,07	1,11% ▲	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.996.053,03	0,00	0,00	5.043.444,97	47.391,94	0,95% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.859.895,63	0,00	0,00	24.121.956,45	262.060,82	1,10% ▲	0,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	7.189.098,57	0,00	0,00	7.107.616,38	-81.482,19	-1,13% ▼	2,57%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	35.520.357,99	0,00	0,00	35.174.821,81	-345.536,18	-0,97% ▼	2,53%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.417.272,13	1.630.000,00	2.300.000,00	11.885.977,51	138.705,38	0,99% ▲	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.358.362,08	0,00	0,00	9.454.404,05	96.041,97	1,03% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.912.100,99	0,00	0,00	3.926.022,73	13.921,74	0,36% ▲	0,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.014.810,62	0,00	0,00	8.023.780,19	8.969,57	0,11% ▲	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	40.912.213,77	0,00	0,00	40.520.655,94	-391.557,83	-0,96% ▼	2,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	302.506,08	0,00	0,00	305.256,52	2.750,44	0,91% ▲	0,07%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	15.796.823,11	1.218.337,24	0,00	16.843.964,81	-171.195,54	-1,01% ▼	2,59%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.536.648,78	0,00	0,00	5.483.283,51	-53.365,27	-0,96% ▼	2,53%
	239.696.081,21	2.848.337,24	2.300.000,00	239.812.197,28	-432.221,17	-0,18%	1,56%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.281.953,91	0,00	0,00	1.268.422,06	-13.531,85	-1,06% ▼	9,04%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	902.655,08	0,00	0,00	900.038,18	-2.616,90	-0,29% ▼	6,89%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	7.586.786,08	0,00	0,00	7.655.234,01	68.447,93	0,90% ▲	7,77%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	10.058.472,11	0,00	0,00	10.145.883,47	87.411,36	0,87% ▲	8,29%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	15.733.895,33	0,00	0,00	15.718.025,99	-15.869,34	-0,10% ▼	7,42%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.940.279,35	0,00	0,00	3.977.188,15	36.908,80	0,94% ▲	7,84%
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1.190.883,86	0,00	0,00	1.204.260,71	13.376,85	1,12% ▲	9,85%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	3.260.309,40	0,00	0,00	3.232.842,84	-27.466,56	-0,84% ▼	7,29%
-	43.955.235,12	0,00	0,00	44.101.895,41	146.660,29	0,33%	7,81%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	330.372,00	0,00	0,00	324.520,00	-5.852,00	-1,77% ▼	7,01%
-	330.372,00	0,00	0,00	324.520,00	-5.852,00	-1,77%	7,01%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.699.586,55	0,00	0,00	7.441.555,64	-258.030,91	-3,35% ▼	6,92%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.697.104,82	0,00	0,00	2.605.204,77	-91.900,05	-3,41% ▼	4,69%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.815.179,32	0,00	0,00	2.714.539,90	-100.639,42	-3,57% ▼	4,97%
	13.211.870,69	0,00	0,00	12.761.300,31	-450.570,38	-3,41%	4,99%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.974.623,17	0,00	0,00	5.069.379,10	94.755,93	1,90% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	32.360.177,28	0,00	0,00	32.152.105,45	-208.071,83	-0,64% ▼
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	25.178.360,16	0,00	0,00	25.989.995,32	811.635,16	3,22% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	567.939,03	0,00	16.575,91	568.622,10	17.258,98	3,04% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.128.103,31	0,00	237.083,86	8.140.910,44	249.890,99	3,07% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.890.179,67	0,00	0,00	5.043.444,97	153.265,30	3,13% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.055.601,36	0,00	667.536,80	24.121.956,45	733.891,89	3,05% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	7.160.343,15	0,00	0,00	7.107.616,38	-52.726,77	-0,74% ▼
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	32.350.763,21	3.053.652,25	0,00	35.174.821,81	-229.593,65	-0,65% ▼
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.571.341,98	1.630.000,00	4.775.000,00	11.885.977,51	459.635,53	2,84% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.193.721,17	0,00	2.100.000,00	9.454.404,05	360.682,88	3,22% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.846.793,91	0,00	0,00	3.926.022,73	79.228,82	2,06% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.892.138,08	0,00	0,00	8.023.780,19	131.642,11	1,67% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	40.737.959,49	0,00	0,00	40.520.655,94	-217.303,55	-0,53% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	296.011,90	0,00	0,00	305.256,52	9.244,62	3,12% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	13.302.895,49	3.652.091,20	0,00	16.843.964,81	-111.021,88	-0,65% ▼
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.514.957,86	0,00	0,00	5.483.283,51	-31.674,35	-0,57% ▼
	237.021.910,22	8.335.743,45	7.796.196,57	239.812.197,28	2.250.740,18	0,95%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.313.156,57	0,00	0,00	1.268.422,06	-44.734,51	-3,41% ▼
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	921.196,57	0,00	900.038,18	-21.158,39	-2,30% ▼
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	7.736.291,30	0,00	0,00	7.655.234,01	-81.057,29	-1,05% ▼
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	10.087.189,58	0,00	0,00	10.145.883,47	58.693,89	0,58% ▲
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	16.047.344,99	0,00	0,00	15.718.025,99	-329.319,00	-2,05% ▼
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	4.045.076,76	0,00	0,00	3.977.188,15	-67.888,61	-1,68% ▼
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1.209.229,04	0,00	0,00	1.204.260,71	-4.968,33	-0,41% ▼
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	3.337.553,26	0,00	0,00	3.232.842,84	-104.710,42	-3,14% ▼
	43.775.841,50	921.196,57	0,00	44.101.895,41	-595.142,66	-1,33%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	293.944,00	0,00	0,00	324.520,00	30.576,00	10,40% ▲
	293.944,00	0,00	0,00	324.520,00	30.576,00	10,40%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.362.742,09	0,00	0,00	7.441.555,64	78.813,55	1,07% ▲
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.576.086,88	0,00	0,00	2.605.204,77	29.117,89	1,13% ▲
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.679.058,43	0,00	0,00	2.714.539,90	35.481,47	1,32% ▲
	12.617.887,40	0,00	0,00	12.761.300,31	143.412,91	1,14%

Cenário Econômico

Na esteira de agosto, o mês de setembro também foi de grande desafio para a gestão dos investimentos. Na renda fixa, mais uma vez, a abertura da curva de juros prejudicou a rentabilidade dos fundos atrelados a inflação mais longa (IMA-B e IMA-B5+). Na renda variável, os índices tiveram desempenhos mistos; o índice Ibovespa fechou no positivo e o Small Caps fechou em forte baixa. Já os ativos no exterior, com a aceleração das incertezas globais, os índices, no geral, fecharam também em forte baixa. Com tudo isso o mês será de resultados mistos para as carteiras de investimentos. Aqueles que são com maior exposição ao risco, vão fechar com resultados próximos ao zero, já os com menor exposição ao risco, experimentaram rentabilidades ligeiramente superiores.

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 ainda 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 2023. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2023 ainda não foram integralmente atingidos.

Rentabilidade e Risco (por ativo)

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados.

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 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 investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

Na renda fixa, mais uma vez, a abertura da curva de juros prejudicou a rentabilidade dos fundos atrelados a inflação mais longa (IMA-B e IMA-B5+). Na renda variável, os fundos tiveram desempenhos mistos; os fundos atrelados ao índice Ibovespa fecharam no positivo, já os fundos de benchmark Small Caps fecharam em baixa. Já os ativos no exterior, com a aceleração das incertezas globais, no geral fecharam também em baixa.

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 2023, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 06 de outubro de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

