

2023

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.052.663,38	1,71%	5.824.441.376,72	0,09%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.935.429,17	10,80%	5.052.854.726,15	0,63%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	571.094,75	0,19%	189.283.940,27	0,30%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.177.054,41	2,77%	2.503.461.334,36	0,33%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.092.402,83	1,72%	22.756.509,77	22,38%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.227.129,11	8,19%	3.536.045.684,72	0,69%	7º I b
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	34.934.803,88	11,81%	557.432.822,88	6,27%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.914.569,02	1,32%	5.184.421.071,28	0,08%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.997.967,74	2,70%	7.787.487.970,57	0,10%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	40.251.410,76	13,61%	5.036.600.197,80	0,80%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	308.124,49	0,10%	7.795.296.699,71	0,00%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.446.147,24	1,84%	470.057.493,05	1,16%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	26.246.836,16	8,88%	15.296.039.303,73	0,17%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	7.067.933,33	2,39%	502.816.901,55	1,41%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.504.176,21	3,89%	8.965.211.424,43	0,13%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.550.551,25	3,23%	14.076.402.461,33	0,07%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	17.936.657,79	6,07%	1.238.456.183,31	1,45%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.188.471,62	0,40%	1.166.023.248,50	0,10%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	843.494,90	0,29%	465.759.490,78	0,18%	8º I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	7.378.537,09	2,50%	730.788.793,77	1,01%	8º I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	9.807.638,35	3,32%	785.462.483,47	1,25%	8º I
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	15.236.591,48	5,15%	493.814.734,05	3,09%	8º I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.844.816,60	1,30%	617.426.719,37	0,62%	8º I
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1.166.720,00	0,39%	44.204.703,46	2,64%	8º I
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	3.148.743,35	1,06%	216.349.332,72	1,46%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.303.531,81	2,47%	429.910.854,12	1,70%	9º III
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.568.585,06	0,87%	112.449.121,34	2,28%	9º III

Investimentos

\$ 295.699.241,14

Disponibilidades Financeiras

\$ 252.368,36

Total Carteira

\$ 295.951.609,50

Governança (Pró Gestão)


Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.676.559,36	0,91%	1.935.277.303,73	0,14%	9º III
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	320.600,00	0,11%	182.055.000,00	0,18%	11º


Investimentos

 295.699.241,14

Disponibilidades Financeiras

 252.368,36

Total Carteira

 295.951.609,50

Governança (Pró Gestão)

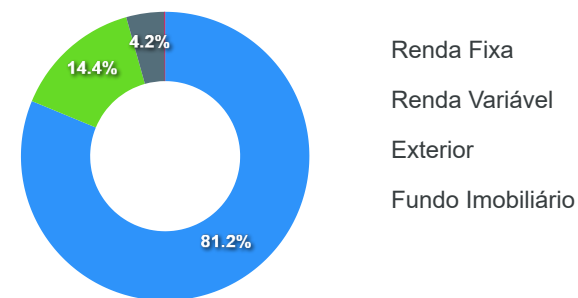


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	56,74%	167.908.796,78 43,26%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	24,43%	72.306.154,74 35,57%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	14,40%	42.615.013,39 15,60%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	4,24%	12.548.676,23 5,76%
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,11%	320.600,00 4,89%

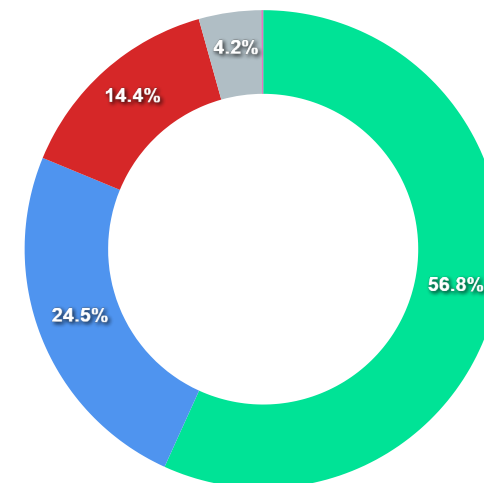
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



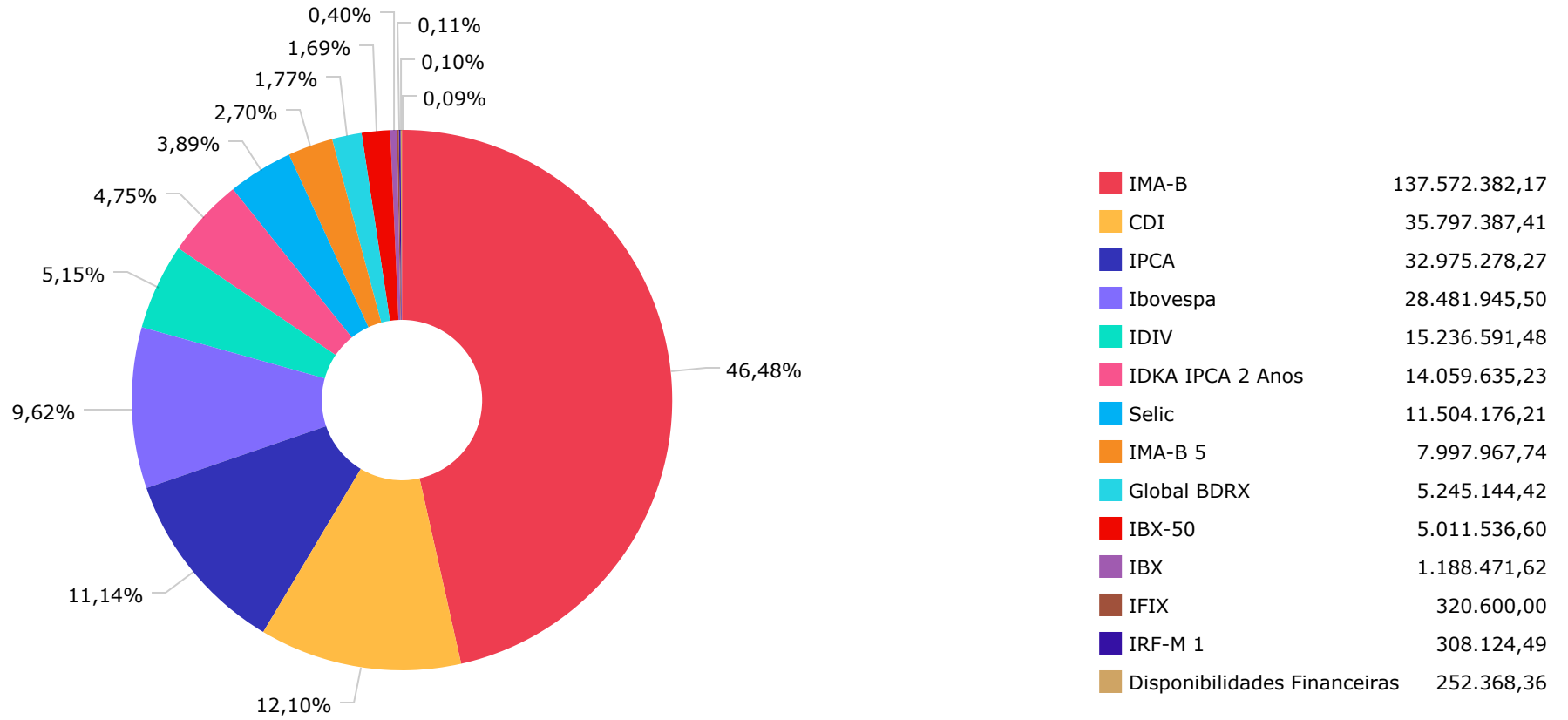
Artigos

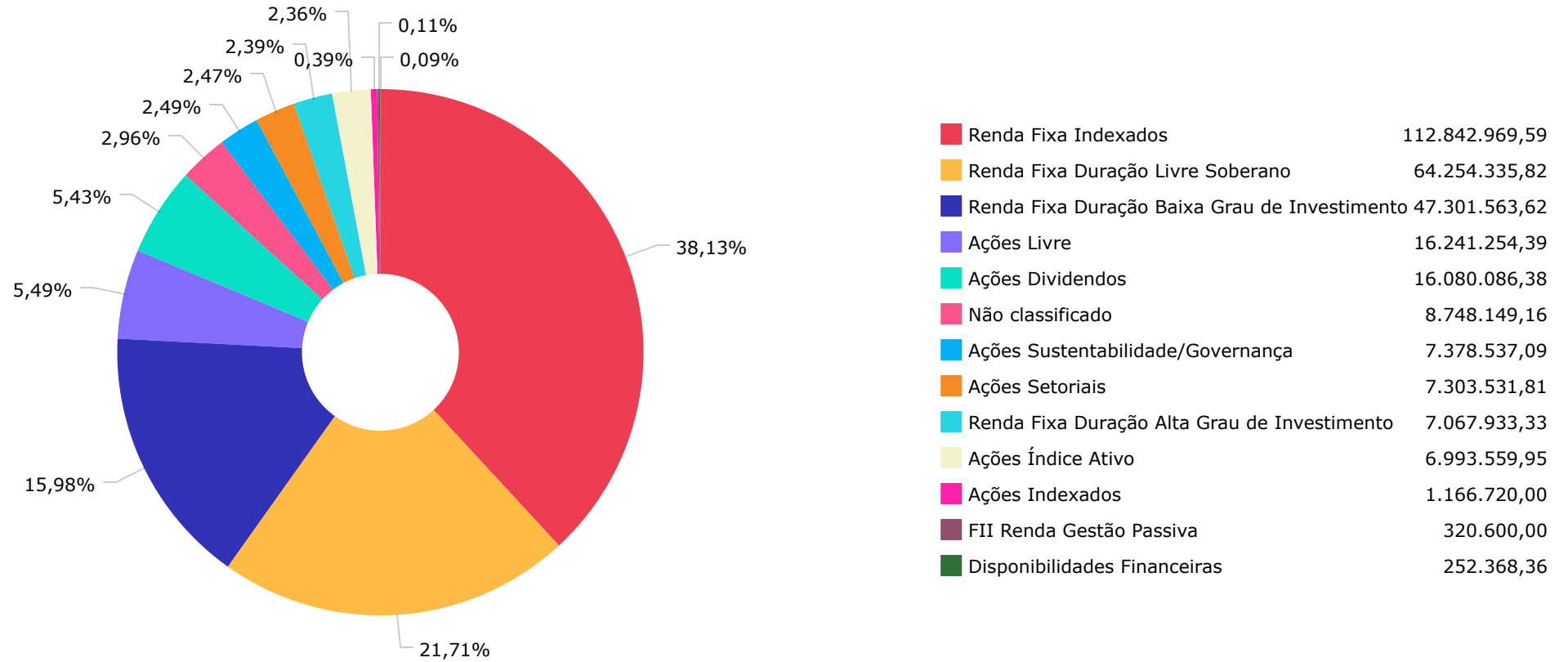


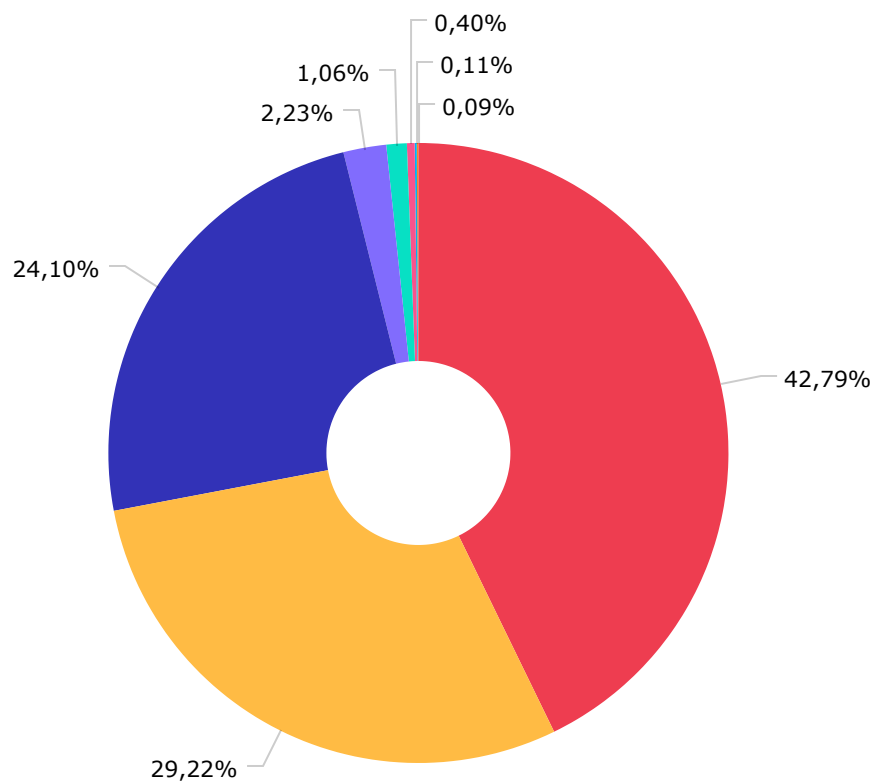
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	5,00%	100,00%	295.951.609,50	8° I - Fundos de Ações	14,40%	0,00%	16,00%	30,00%	46.170.469,46
7° I b - FI 100% Títulos TN	56,74%	0,00%	19,00%	100,00%	128.042.812,72	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	88.785.482,85
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	295.951.609,50	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	29.595.160,95
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	14.797.580,48	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	29.595.160,95
7° III a - FI Referenciados RF	24,43%	0,00%	50,00%	60,00%	105.264.810,96	9° III - Ações - BDR Nível I	4,24%	0,00%	4,00%	10,00%	17.046.484,72
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	177.570.965,70	10° I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	29.595.160,95
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	59.190.321,90	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	14.797.580,48
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	14.797.580,48	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	14.797.580,48
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	14.797.580,48	11° - Fundos Imobiliários	0,11%	0,00%	1,00%	5,00%	14.476.980,48
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	14.797.580,48	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	14.797.580,48

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,02	11,21	3,32	6,91	13,65	27,03	0,02	0,03
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,99	10,95	3,15	6,60	13,35	26,71	0,01	0,02
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	-1,57	15,39	-1,87	6,65	18,36	-16,13		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40	14,42	-2,16	6,20	16,47	-17,58	7,82	16,48
BRASESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,41	6,11	-1,62	3,06	6,42	-18,84	7,20	15,16
IBOVESPA - BENCHMARK	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32		
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,85	27,41	-3,16	16,51	10,47	-13,23	8,85	18,63
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-6,28	7,38	-11,39	5,29	-0,93	10,47	8,83	18,59
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-3,61	1,59	-7,80	8,08	-4,91	5,72	7,29	15,35
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	-2,60	1,96	-8,11	6,14	-5,69	11,53	6,75	14,21
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-3,33	-0,10	-6,99	6,49	-11,81	-11,85	7,60	16,01
IBX - BENCHMARK	-3,03	2,31	-7,11	8,24	-3,47	7,90		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-6,30	-0,81	-13,08	3,12	-12,18	-11,03	10,45	22,01
IBX-50 - BENCHMARK	-2,99	1,78	-6,48	8,57	-2,99	9,63		
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	-3,12	0,75	-6,76	7,96	-3,99	6,96	7,00	14,74
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-3,33	0,25	-8,14	6,16	-8,03	3,74	7,43	15,64
IDIV - BENCHMARK	-3,15	7,18	-4,65	7,57	6,28	23,78		
BRASESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,06	1,42	-8,09	6,19	-3,74	14,87	7,59	15,99
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97	10,75	3,06	6,38	13,12	29,17	0,00	0,00

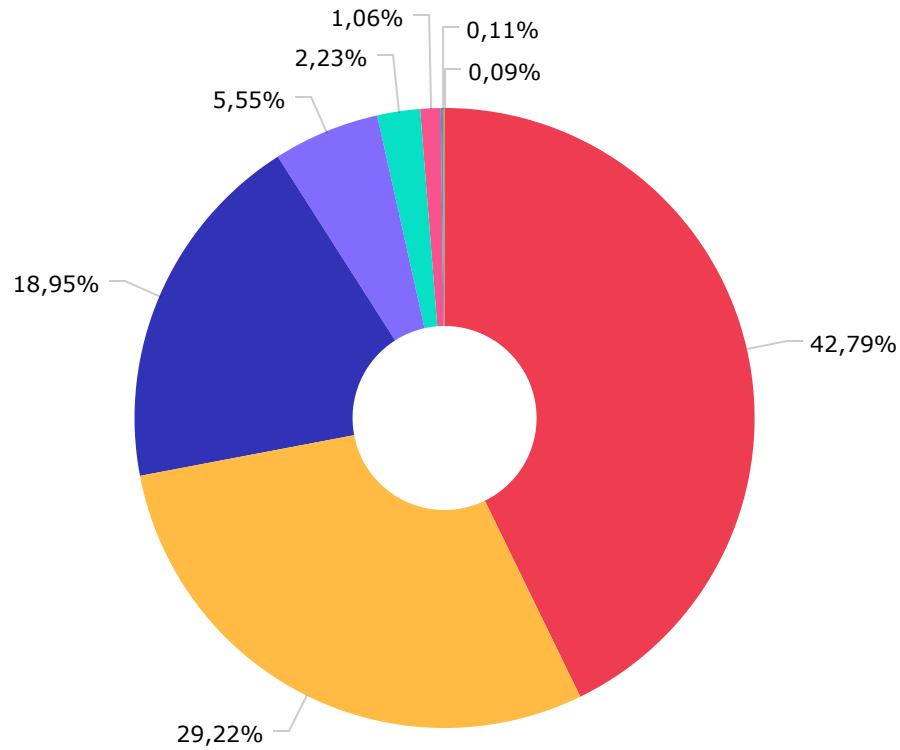
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29	8,48	0,84	3,19	9,04	22,01	1,24	2,60
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,33	8,23	0,62	3,00	8,84	22,05	1,32	2,78
IMA-B - BENCHMARK	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,56	10,03	-2,07	3,74	8,77	20,74	3,05	6,41
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,66	9,92	-1,98	3,69	8,75	20,99	3,00	6,32
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,67	9,82	-2,03	3,63	8,70	20,76	3,00	6,32
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,68	9,83	-2,03	3,63	8,69	20,81	3,01	6,34
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,71	9,92	-2,04	3,71	8,67	20,77	3,10	6,53
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,68	9,78	-2,05	3,59	8,65	20,62	3,01	6,34
IMA-B 5 - BENCHMARK	-0,31	8,55	0,43	3,06	9,21	23,11		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,32	8,44	0,39	3,03	9,06	22,79	1,43	3,01
IPCA - BENCHMARK	0,24	3,75	0,73	1,00	4,82	11,60		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44	9,29	2,46	4,49	10,17		0,48	1,00
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43	9,27	2,45	4,48	10,14	24,15	0,47	1,00
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44		2,48				0,48	1,00
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,96	11,12	3,06	6,61	13,48	26,55		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94	10,95	2,99	6,48	13,26	26,00	0,12	0,25
SELIC - BENCHMARK	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05	11,47	3,41	7,05	13,96	27,79	0,02	0,03
IFIX - BENCHMARK	-1,97	10,06	-1,30	10,41	5,49	17,94		
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	-1,21	14,51	4,20	21,46	13,99	11,63	5,70	12,00







BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	126.635.811,96
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	86.480.657,01
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	71.312.089,96
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	6.612.867,24
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	3.148.743,35
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	1.188.471,62
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DT...	320.600,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	252.368,36



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	126.635.811,96
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	86.480.657,01
BANCO BRADESCO S.A.	56.075.498,48
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	16.425.063,10
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	6.612.867,24
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	3.148.743,35
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DT...	320.600,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	252.368,36

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%	0,66%	7,46%	115,15%	2,69%
Outubro	296.999.913,00	2.906.139,41	2.200.000,00	295.699.241,14	-2.006.811,27	21.303.638,94	-0,67% ▼	7,86%	0,66%	8,17%	96,21%	2,98%

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%	1,91%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

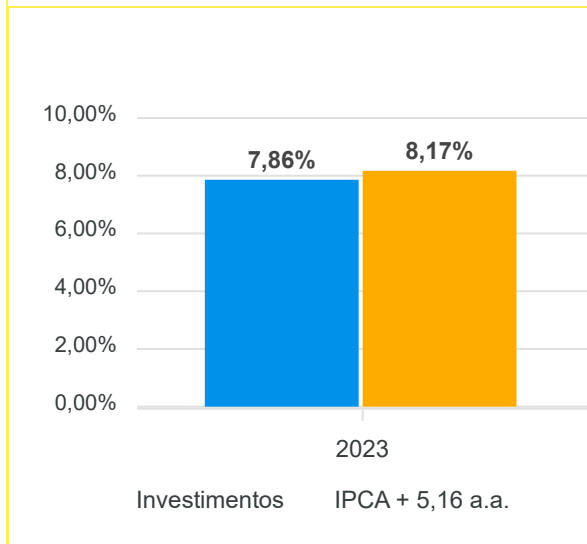


Gráfico Risco x Retorno

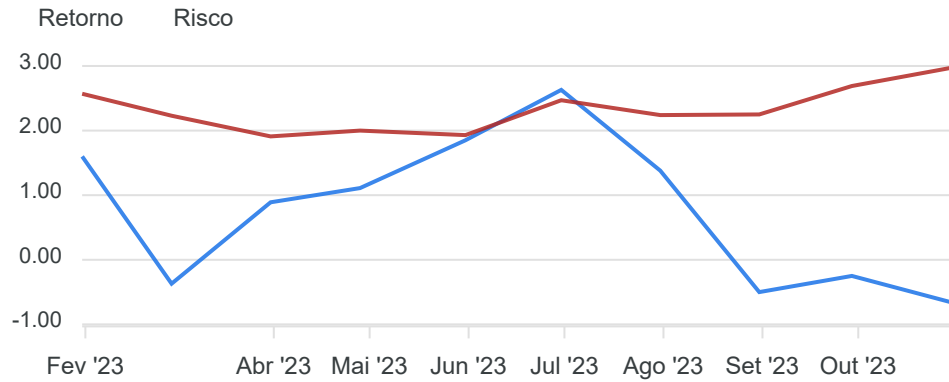
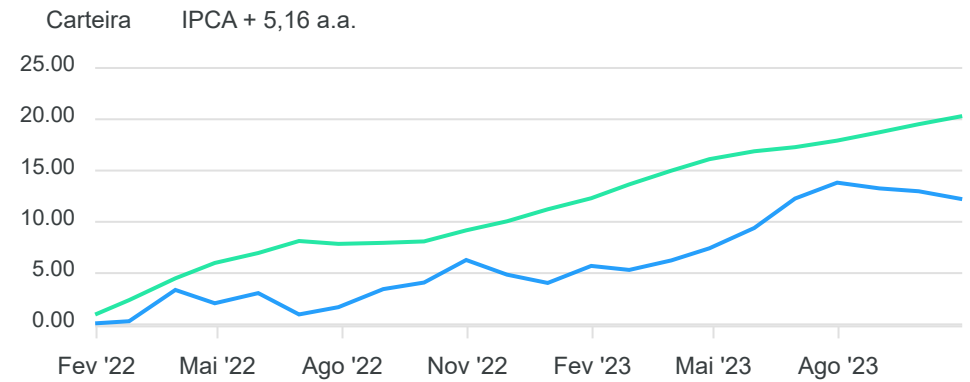
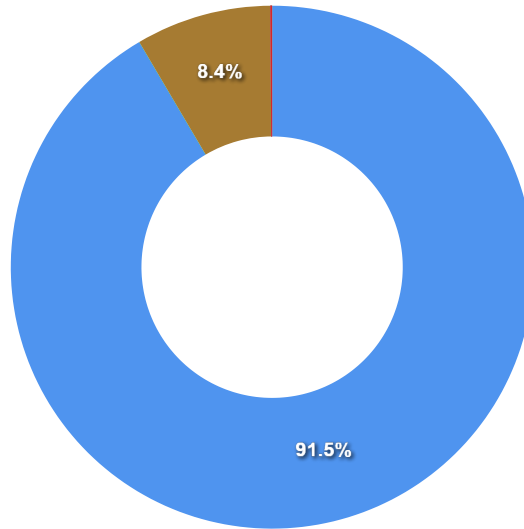


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/10/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	270.832.785,64	91,59
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	24.798.223,86	8,39
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	320.600,00	0,11



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.069.379,10	0,00	0,00	5.052.663,38	-16.715,72	-0,33% ▼	1,32%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	32.152.105,45	0,00	0,00	31.935.429,17	-216.676,28	-0,67% ▼	3,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	25.989.995,32	0,00	0,00	26.246.836,16	256.840,84	0,99% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	568.622,10	0,00	0,00	571.094,75	2.472,65	0,43% ▲	0,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.140.910,44	0,00	0,00	8.177.054,41	36.143,97	0,44% ▲	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.043.444,97	0,00	0,00	5.092.402,83	48.957,86	0,97% ▲	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.121.956,45	0,00	0,00	24.227.129,11	105.172,66	0,44% ▲	0,48%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	7.107.616,38	0,00	0,00	7.067.933,33	-39.683,05	-0,56% ▼	3,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	35.174.821,81	0,00	0,00	34.934.803,88	-240.017,93	-0,68% ▼	3,01%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.885.977,51	1.685.000,00	2.200.000,00	11.504.176,21	133.198,70	0,98% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.454.404,05	0,00	0,00	9.550.551,25	96.147,20	1,02% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.926.022,73	0,00	0,00	3.914.569,02	-11.453,71	-0,29% ▼	1,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.023.780,19	0,00	0,00	7.997.967,74	-25.812,45	-0,32% ▼	1,43%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	40.520.655,94	0,00	0,00	40.251.410,76	-269.245,18	-0,66% ▼	3,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	305.256,52	0,00	0,00	308.124,49	2.867,97	0,94% ▲	0,12%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	16.843.964,81	1.221.139,41	0,00	17.936.657,79	-128.446,43	-0,71% ▼	3,10%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.483.283,51	0,00	0,00	5.446.147,24	-37.136,27	-0,68% ▼	3,01%
	239.812.197,28	2.906.139,41	2.200.000,00	240.214.951,52	-303.385,17	-0,13%	1,89%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.268.422,06	0,00	0,00	1.188.471,62	-79.950,44	-6,30% ▼	10,45%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	900.038,18	0,00	0,00	843.494,90	-56.543,28	-6,28% ▼	8,83%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	7.655.234,01	0,00	0,00	7.378.537,09	-276.696,92	-3,61% ▼	7,29%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	10.145.883,47	0,00	0,00	9.807.638,35	-338.245,12	-3,33% ▼	7,60%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	15.718.025,99	0,00	0,00	15.236.591,48	-481.434,51	-3,06% ▼	7,59%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.977.188,15	0,00	0,00	3.844.816,60	-132.371,55	-3,33% ▼	7,43%
SANTANDER PIBB FI AÇÕES	1.204.260,71	0,00	0,00	1.166.720,00	-37.540,71	-3,12% ▼	7,00%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	3.232.842,84	0,00	0,00	3.148.743,35	-84.099,49	-2,60% ▼	6,75%
-	44.101.895,41	0,00	0,00	42.615.013,39	-1.486.882,02	-3,37%	7,55%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	324.520,00	0,00	0,00	320.600,00	-3.920,00	-1,21% ▼	5,70%
-	324.520,00	0,00	0,00	320.600,00	-3.920,00	-1,21%	5,70%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.441.555,64	0,00	0,00	7.303.531,81	-138.023,83	-1,85% ▼	8,85%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.605.204,77	0,00	0,00	2.568.585,06	-36.619,71	-1,41% ▼	7,20%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.714.539,90	0,00	0,00	2.676.559,36	-37.980,54	-1,40% ▼	7,82%
	12.761.300,31	0,00	0,00	12.548.676,23	-212.624,08	-1,67%	6,62%

Cenário Econômico

Assim como nos dois últimos meses, o mês de outubro foi mais um de resultados ruins para as carteiras de investimentos. No segmento de renda fixa, resultados mistos. Mais uma vez os fundos atrelados a inflação tiveram desempenho fraco com a continuação da abertura da curva de juros, por outro lado continuaram fazendo um bom trabalho de defesa os fundos atrelados ao CDI que fecharam no positivo. Já no segmento de renda variável, a realidade não foi boa para todos os índices de referência no mercado que fecharam em forte baixa no mês. Em resumo, a grande maioria das carteiras de investimentos experimentaram mais um mês de resultados ruins, mas aquelas que possuem uma boa diversificação ainda conseguem um resultado superior a meta atuarial no ano, com a gordura acumulada no primeiro semestre de 2023.

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

Nos segmentos de renda fixa e investimentos estruturados, destacamos mais uma vez os fundos atrelados a inflação que tiveram desempenho fraco com a continuação da abertura da curva de juros, por outro lado continuaram fazendo um bom trabalho de defesa os fundos atrelados ao CDI que fecharam no positivo. Já nos segmentos de renda variável e investimentos no exterior, a realidade não foi boa para a maioria dos índices de referência no mercado que fecharam em baixa no mês.

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, 09 de novembro de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

