

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
TÍTULOS PÚBLICOS	10.725.374,43	12,11%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	520.608,57	0,59%	6.082.622.569,66	0,01%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	528.665,81	0,60%	5.052.854.726,15	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	799.254,60	0,90%	990.612.617,19	0,08%	7º I b
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.268.607,37	2,56%	177.838.788,20	1,28%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	599.661,63	0,68%	5.136.324.306,86	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	726.037,38	0,82%	5.184.421.071,28	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.637.287,11	1,85%	7.787.487.970,57	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.815.386,63	14,47%	5.036.600.197,80	0,25%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.212.370,51	1,37%	7.795.296.699,71	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	35.993,10	0,04%	12.230.065.528,97	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.931.931,15	3,31%	2.180.749.467,31	0,13%	7º I b
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	760.317,78	0,86%	303.682.805,99	0,25%	7º I b
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.893.626,69	11,17%	719.918.838,80	1,37%	7º III a
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.199.271,92	4,74%	11.598.043.392,40	0,04%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.051.169,92	13,61%	154.273.833,15	7,81%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.253.560,60	1,42%	1.238.456.183,31	0,10%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.094,50	0,00%	2.862.461.637,51	0,00%	7º III a
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.512.499,62	1,71%	730.788.793,77	0,21%	8º I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.576.970,95	2,91%	262.072.763,64	0,98%	8º I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.715.599,52	1,94%	406.505.009,85	0,42%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	831.638,46	0,94%	1.324.436.773,75	0,06%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.036.593,55	3,43%	586.219.451,06	0,52%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.950.605,16	2,20%	225.472.961,84	0,87%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.139.381,24	1,29%	1.226.062.847,62	0,09%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.443.322,38	1,63%	1.495.048.092,10	0,10%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	700.056,10	0,79%	142.629.819,49	0,49%	8º I

Investimentos

\$ 88.543.333,00

Disponibilidades Financeiras

\$ 233.552,36

Total Carteira

\$ 88.776.885,36

Governança (Pró Gestão)

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	324.216,30	0,37%	306.871.135,96	0,11%	8º I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	193.350,79	0,22%	71.036.701,78	0,27%	8º I
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	949.879,56	1,07%	15.393.193,15	6,17%	9º II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	726.056,68	0,82%	600.007.581,21	0,12%	9º II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	1.064.175,45	1,20%	277.036.853,08	0,38%	9º II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.513.366,74	1,71%	1.935.277.303,73	0,08%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.238.509,45	1,40%	92.215.190,50	1,34%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	513.488,97	0,58%	1.436.932.092,12	0,04%	10º I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.153.402,38	4,69%	1.452.300.441,47	0,29%	10º I

Investimentos

\$ 88.543.333,00

Disponibilidades Financeiras

\$ 233.552,36

Total Carteira

\$ 88.776.885,36

Governança (Pró Gestão)

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	10/12/2021	Curva - Taxa: 5,0200%	29	4.441,610056	128.806,69
NTN-B - 15/05/2035	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,6800%	20	4.754,354953	95.087,10
NTN-B - 15/08/2040	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7500%	49	4.804,200307	235.405,82
NTN-B - 15/05/2045	26/03/2020	Curva - Taxa: 4,5500%	146	5.091,174732	743.311,51
NTN-B - 15/05/2045	09/09/2021	Curva - Taxa: 4,8600%	351	4.901,759061	1.720.517,43
NTN-B - 15/05/2045	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	72	4.961,73224	357.244,72
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2019	Curva - Taxa: 4,4000%	122	5.246,462502	640.068,43
NTN-B - 15/08/2050	31/03/2020	Curva - Taxa: 4,4600%	71	5.201,86184	369.332,19
NTN-B - 15/08/2050	02/04/2020	Curva - Taxa: 4,5900%	146	5.107,129069	745.640,84
NTN-B - 15/08/2050	06/04/2020	Curva - Taxa: 4,6800%	123	5.043,024968	620.292,07
NTN-B - 15/08/2050	08/04/2020	Curva - Taxa: 4,6300%	122	5.078,491055	619.575,91
NTN-B - 15/08/2050	09/04/2020	Curva - Taxa: 4,7300%	124	5.007,928751	620.983,17
NTN-B - 15/08/2050	15/05/2020	Curva - Taxa: 4,6400%	147	5.071,367915	745.491,08
NTN-B - 15/08/2050	23/11/2020	Curva - Taxa: 4,3400%	3	5.291,620049	15.874,86
NTN-B - 15/08/2050	10/03/2021	Curva - Taxa: 4,1500%	19	5.438,434025	103.330,25
NTN-B - 15/08/2050	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7800%	69	4.973,189939	343.150,11
NTN-B - 15/08/2050	15/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	29	4.303,240782	124.793,98
NTN-B - 15/05/2055	01/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	359	5.112,199215	1.835.279,52
NTN-B - 15/05/2055	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,8000%	134	5.081,90717	680.975,56

Investimentos

\$ 88.543.333,00

Disponibilidades Financeiras

\$ 233.552,36

Total Carteira

\$ 88.776.885,36

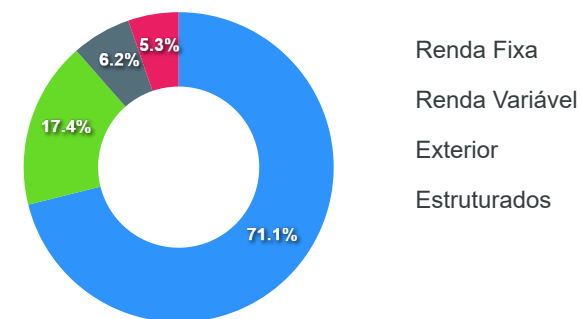
Governança (Pró Gestão)

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	12,08%	10.725.374,43 87,92%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	27,98%	24.836.121,64 72,02%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	30,86%	27.398.723,63 29,14%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	17,37%	15.424.234,07 12,63%
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,09%	2.740.111,69 6,91%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,10%	2.751.876,19 6,90%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	5,26%	4.666.891,35 4,74%

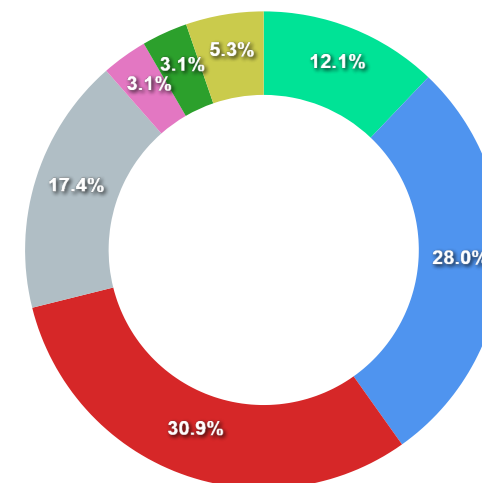
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos

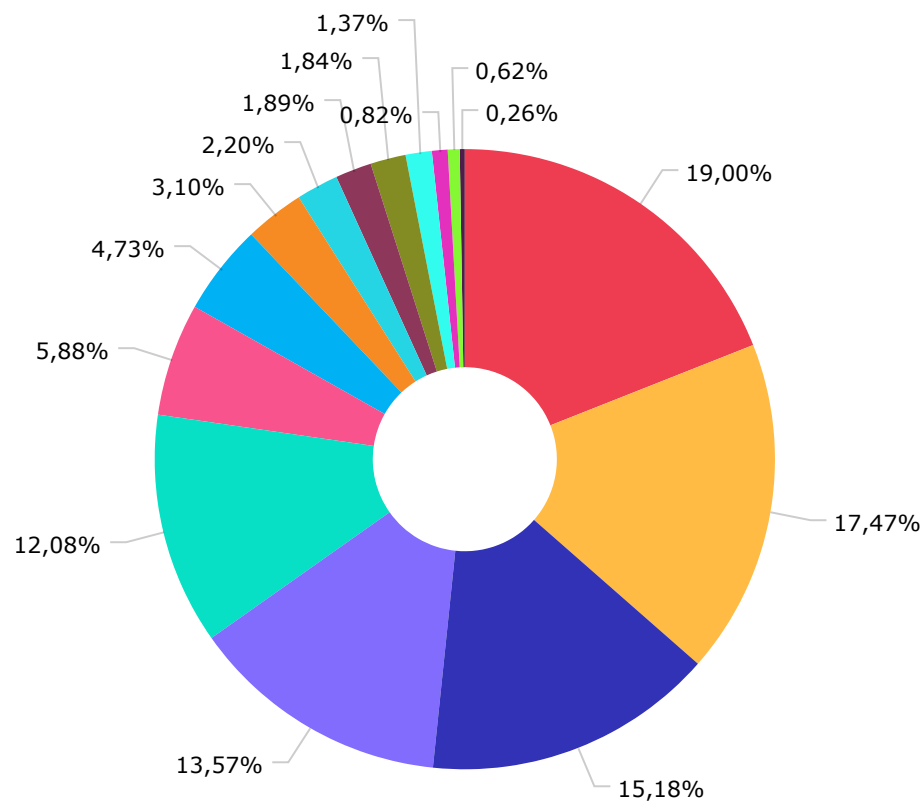


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	12,08%	0,00%	15,00%	100,00%	78.051.510,93	8º I - Fundos de Ações	17,37%	0,00%	28,00%	30,00%	11.208.831,54
7º I b - FI 100% Títulos TN	27,98%	0,00%	20,00%	100,00%	63.940.763,72	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	26.633.065,61
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	88.776.885,36	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.877.688,54
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.438.844,27	9º II - Constituídos no Brasil	3,09%	0,00%	2,00%	10,00%	6.137.576,85
7º III a - FI Referenciados RF	30,86%	0,00%	20,00%	60,00%	25.867.407,59	9º III - Ações - BDR Nível I	3,10%	0,00%	5,00%	10,00%	6.125.812,35
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	53.266.131,22	10º I - Fundos Multimercados	5,26%	0,00%	5,00%	10,00%	4.210.797,19
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	17.755.377,07	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.438.844,27
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.438.844,27	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.438.844,27
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.438.844,27	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.438.844,27
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.438.844,27	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.438.844,27

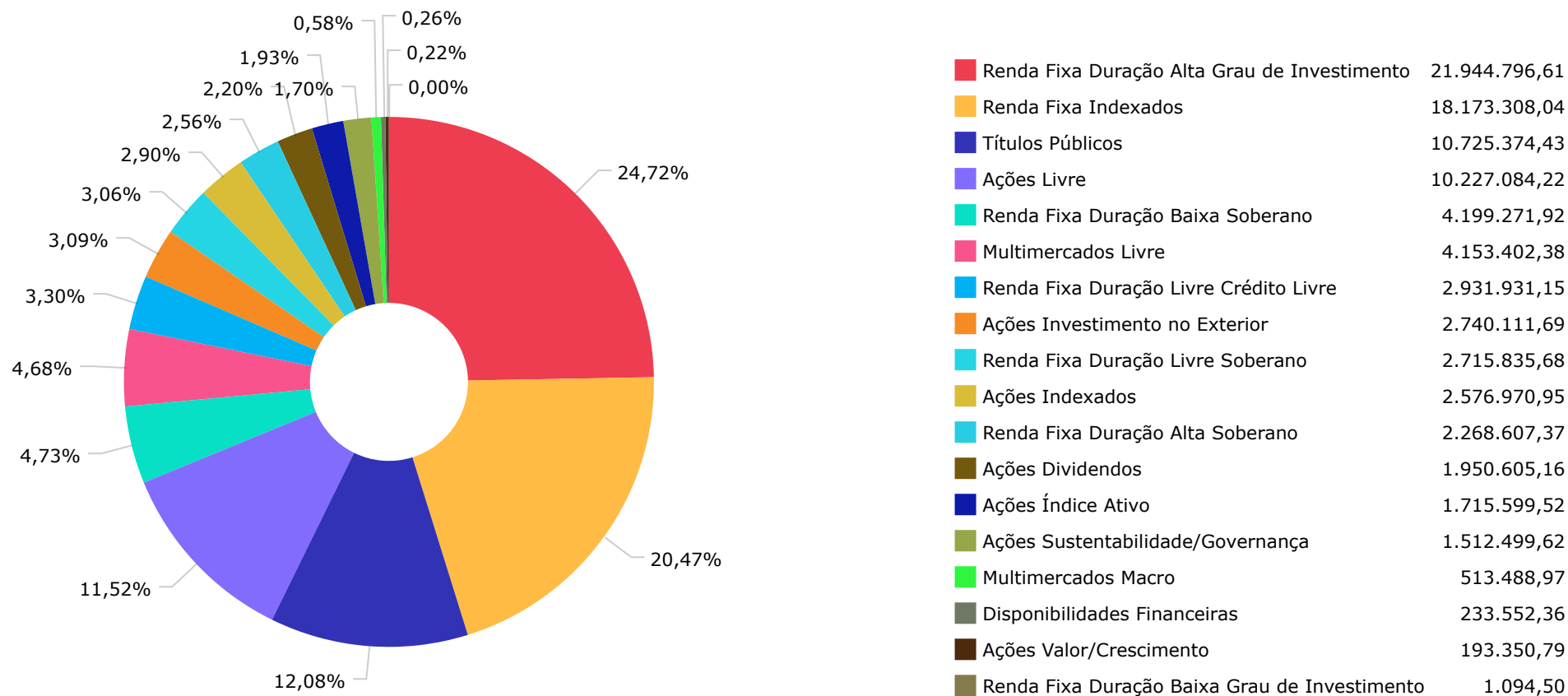
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45		
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,01	11,23	3,40	7,03	13,68	27,37	0,02	0,04
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,96	10,96	3,07	6,61	13,28	26,47	0,02	0,05
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,41	7,92	-0,30	4,88	7,71	21,83	2,40	5,06
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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,32	1,37	0,25	2,48	1,65	-15,01	6,94	14,62
IBOVESPA - BENCHMARK	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32		
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	-2,96	3,15	-7,21	8,35	-2,38	9,36	7,29	15,35
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-3,61	1,59	-7,80	8,08	-4,91	5,72	7,29	15,35
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-3,57	0,80	-8,58	6,88	-6,45	-3,29	7,38	15,53
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-4,68	1,85	-10,23	4,44	-8,65	6,72	7,64	16,10
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-5,07	-4,56	-11,92	3,40	-10,62	2,28	8,24	17,36
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-5,29	0,47	-9,76	7,47	-10,82	-1,56	8,34	17,56
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,86	-1,30	-10,21	8,75	-12,06	-12,83	9,52	20,04
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-5,21	-1,57	-11,24	4,08	-12,29	-6,68	9,57	20,15
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,29	-8,29	-9,21	-1,31	-14,59	-4,03	6,54	13,78
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-7,30	-8,76	-16,03	-0,44	-22,96	-19,27	11,08	23,34
IDIV - BENCHMARK	-3,15	7,18	-4,65	7,57	6,28	23,78		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,13	6,12	-4,69	6,93	5,15	21,02	5,52	11,63
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65		
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

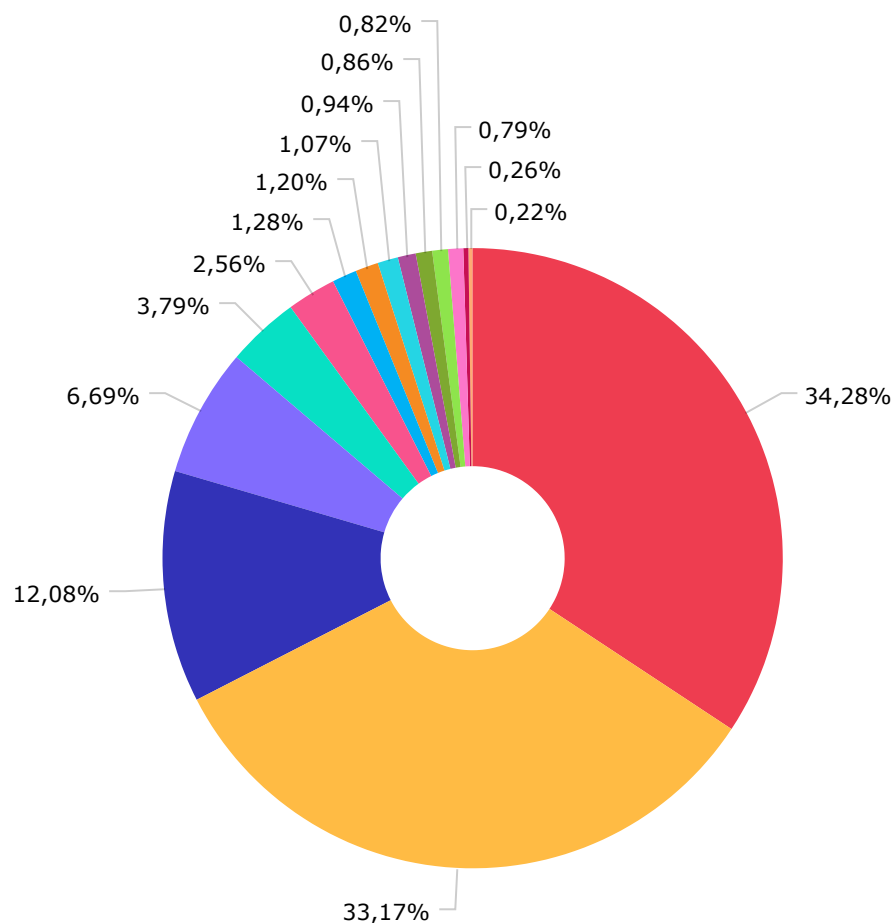
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B - BENCHMARK	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40		
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,58	9,64	-1,84	3,65	8,96	20,96	2,94	6,18
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,66	9,92	-1,98	3,69	8,75	20,99	3,00	6,32
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,67	9,82	-2,03	3,63	8,70	20,76	3,00	6,32
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
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
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-0,98	10,98	-4,11	3,97	8,37	19,37		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,00	10,70	-4,19	3,80	8,05	18,35	4,62	9,72
IPCA - BENCHMARK	0,24	3,75	0,73	1,00	4,82	11,60		
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85	12,67	2,79	7,46	13,41	26,00	0,26	0,55
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,26	10,64	1,30	6,24	12,00	24,61	0,90	1,91
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,29	11,50	1,00	6,19	11,93	23,98	1,32	2,79
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,41	9,50	0,83	5,07	10,70	22,21	1,49	3,13
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,21	11,12	-0,14	5,42	9,56	22,83	2,29	4,81
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,04	8,94	-1,05	2,26	8,60		2,21	4,66
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 FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,96	10,78	3,08	6,43	13,12	25,77	0,01	0,03
MSCI WORLD - BENCHMARK	-2,00	3,11	-3,63	-1,26	4,55	-21,84		

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-4,04	17,98	-6,42	4,14	22,16	-38,88	9,76	20,55
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	-2,98	-5,95	-3,98	-6,47	-1,77	-22,99	7,07	14,89
MSCI ACWI - BENCHMARK	-2,10	1,94	-3,96	-1,70	4,45	-23,43		
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-1,77	15,81	-7,01	4,37	16,80	7,09	7,21	15,18
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-3,95	-1,12	-5,58	-3,90	7,16	-23,69	6,38	13,44

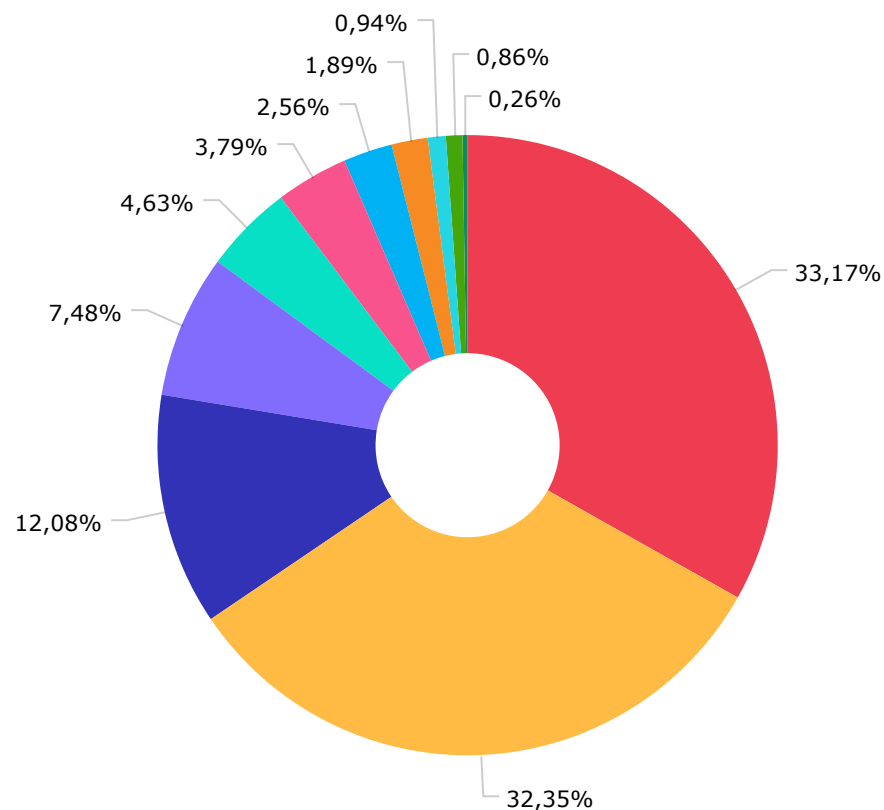


IMA-B	16.866.220,41
IPCA	15.505.400,42
Ibovespa	13.473.628,91
IMA-B 5+	12.051.169,92
Títulos Públicos	10.725.374,43
MSCI ACWI	5.217.577,83
Selic	4.199.271,92
Global BDRX	2.751.876,19
IDIV	1.950.605,16
MSCI WORLD	1.675.936,24
IMA-B 5	1.637.287,11
IRF-M 1	1.212.370,51
IDKA IPCA 2 Anos	726.037,38
CDI	550.576,57
Disponibilidades Financeiras	233.552,36





BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN...	30.436.639,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.447.753,76
TESOURO NACIONAL	10.725.374,43
ITAU UNIBANCO S.A.	5.937.979,28
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.361.028,60
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S....	2.268.607,37
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	1.139.381,24
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.064.175,45
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT B...	949.879,56
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	831.638,46
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	761.412,28
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT...	726.056,68
ITAÚ DTVM S.A.	700.056,10
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	233.552,36
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GEST...	193.350,79



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.447.753,76
BANCO BRADESCO S.A.	28.721.039,48
TESOURO NACIONAL	10.725.374,43
ITAU UNIBANCO S.A.	6.638.035,38
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	4.112.507,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.361.028,60
SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRI...	2.268.607,37
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	1.675.936,24
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	831.638,46
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	761.412,28
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	233.552,36

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	76.550.855,53	871.703,64	255.860,00	78.370.841,73	1.204.142,56	1.204.142,56	1,56% ▲	1,56%	0,99%	0,99%	157,58%	4,28%
Fevereiro	78.370.841,73	1.541.794,21	679.235,13	78.604.427,93	-628.972,88	575.169,68	-0,79% ▼	0,75%	1,22%	2,23%	33,63%	3,54%
Março	78.604.427,93	2.311.001,22	1.358.000,00	80.367.794,75	810.365,60	1.385.535,28	1,02% ▲	1,78%	1,20%	3,45%	51,59%	3,18%
Abril	80.367.794,75	1.366.372,62	567.000,00	82.342.260,71	1.175.093,34	2.560.628,62	1,45% ▲	3,25%	0,99%	4,47%	72,71%	3,07%
Mai	82.342.260,71	2.480.415,53	1.232.046,07	85.591.259,29	2.000.629,12	4.561.257,74	2,39% ▲	5,73%	0,69%	5,20%	110,19%	2,80%
Junho	85.591.259,29	12.187.095,97	11.464.552,72	88.930.753,55	2.616.951,01	7.178.208,75	3,03% ▲	8,93%	0,36%	5,58%	160,04%	3,10%
Julho	88.930.753,55	705.040,60	430.000,00	90.422.775,77	1.216.981,62	8.395.190,37	1,36% ▲	10,42%	0,56%	6,17%	168,88%	2,71%
Agosto	90.422.775,77	673.115,48	264.698,11	90.025.812,75	-805.380,39	7.589.809,98	-0,89% ▼	9,44%	0,71%	6,93%	136,22%	2,78%
Setembro	90.025.812,75	182.750,27	60.000,00	89.550.817,74	-597.745,28	6.992.064,70	-0,66% ▼	8,71%	0,68%	7,66%	113,71%	3,14%
Outubro	89.550.817,74	83.678,39	89.000,00	88.543.333,00	-1.002.163,13	5.989.901,57	-1,12% ▼	7,50%	0,68%	8,39%	89,39%	3,65%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	1.385.535,28	1,78%	3,45%
2º Trim	5.792.673,47	7,03%	2,06%
1º Sem	7.178.208,75	8,93%	5,58%
3º Trim	-186.144,05	-0,20%	1,97%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

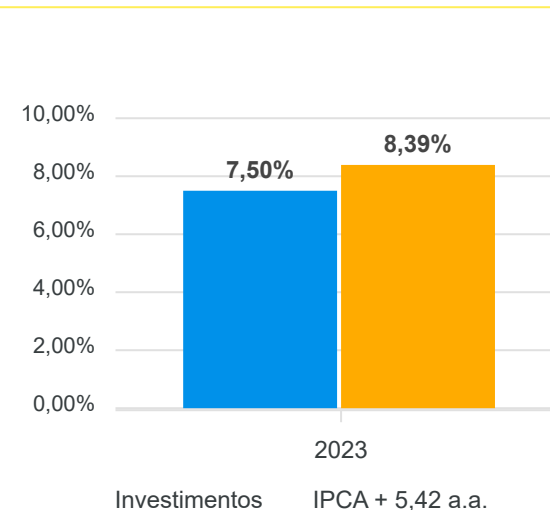


Gráfico Risco x Retorno

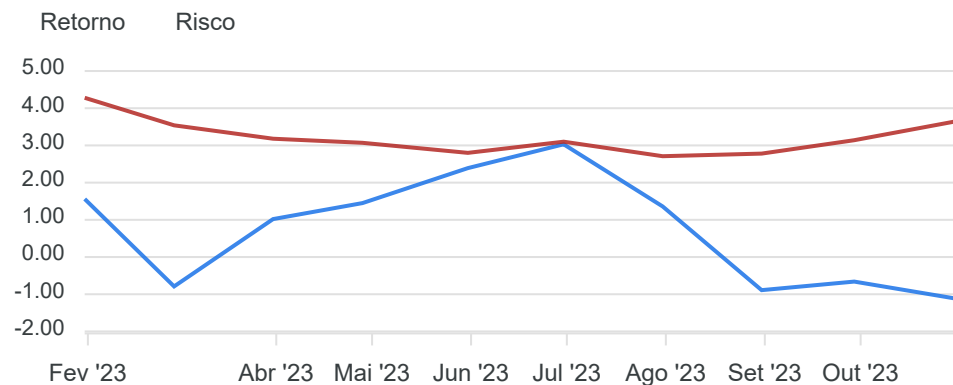
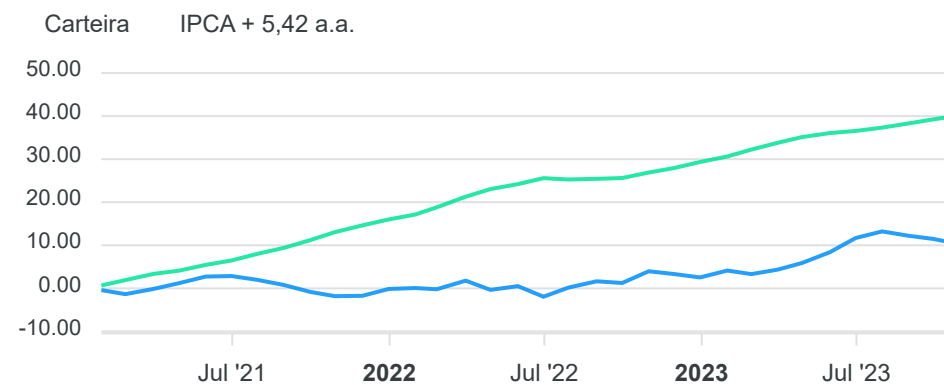
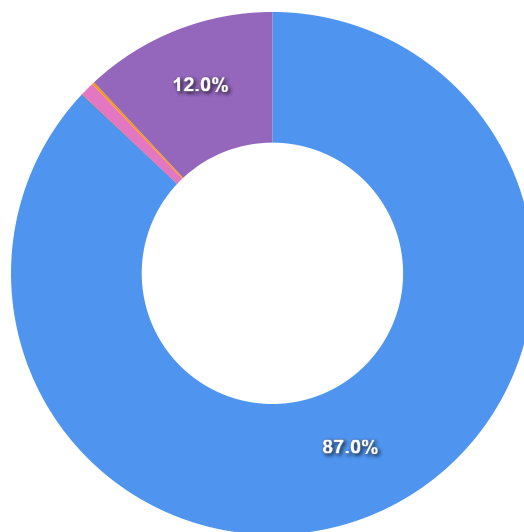


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/10/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	77.252.256,33	87,25
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	799.254,60	0,90
Até D+3600	128.806,69	0,15
Acima D+3600	10.616.354,54	11,99
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	10.658.599,59	0,00	0,00	10.725.374,43	66.774,84	0,63% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	516.216,50	0,00	0,00	520.608,57	4.392,07	0,85% ▲	0,26%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	532.252,72	0,00	0,00	528.665,81	-3.586,91	-0,67% ▼	3,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	807.664,24	0,00	0,00	799.254,60	-8.409,64	-1,04% ▼	2,21%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.281.776,76	0,00	0,00	2.268.607,37	-13.169,39	-0,58% ▼	2,94%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.865.071,06	0,00	0,00	9.893.626,69	28.555,63	0,29% ▲	1,32%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.159.433,15	0,00	0,00	4.199.271,92	39.838,77	0,96% ▲	0,01%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.173.333,20	0,00	0,00	12.051.169,92	-122.163,28	-1,00% ▼	4,62%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	598.126,55	0,00	0,00	599.661,63	1.535,08	0,26% ▲	0,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	728.161,71	0,00	0,00	726.037,38	-2.124,33	-0,29% ▼	1,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.642.571,25	0,00	0,00	1.637.287,11	-5.284,14	-0,32% ▼	1,43%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.901.109,86	0,00	0,00	12.815.386,63	-85.723,23	-0,66% ▼	3,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.201.085,99	0,00	0,00	1.212.370,51	11.284,52	0,94% ▲	0,12%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	35.652,39	0,00	0,00	35.993,10	340,71	0,96% ▲	0,02%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.262.547,68	0,00	0,00	1.253.560,60	-8.987,08	-0,71% ▼	3,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.938.042,77	0,00	0,00	2.931.931,15	-6.111,62	-0,21% ▼	2,29%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	757.203,18	0,00	0,00	760.317,78	3.114,60	0,41% ▲	1,49%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.796,45	83.678,39	89.000,00	1.094,50	619,66	0,69% ▲	0,02%
	63.064.645,05	83.678,39	89.000,00	62.960.219,70	-99.103,74	-0,16%	2,11%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.569.218,72	0,00	0,00	1.512.499,62	-56.719,10	-3,61% ▼	7,29%
BRADERCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	2.655.547,10	0,00	0,00	2.576.970,95	-78.576,15	-2,96% ▼	7,29%
BRADERCO SELECTION FIAÇÕES	1.807.194,27	0,00	0,00	1.715.599,52	-91.594,75	-5,07% ▼	8,24%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	865.033,14	0,00	0,00	831.638,46	-33.394,68	-3,86% ▼	9,52%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.206.096,43	0,00	0,00	3.036.593,55	-169.502,88	-5,29% ▼	8,34%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.013.669,64	0,00	0,00	1.950.605,16	-63.064,48	-3,13% ▼	5,52%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.195.294,41	0,00	0,00	1.139.381,24	-55.913,17	-4,68% ▼	7,64%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.507.968,84	0,00	0,00	1.443.322,38	-64.646,46	-4,29% ▼	6,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	738.504,52	0,00	0,00	700.056,10	-38.448,42	-5,21% ▼	9,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	349.741,38	0,00	0,00	324.216,30	-25.525,08	-7,30% ▼	11,08%
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	200.500,19	0,00	0,00	193.350,79	-7.149,40	-3,57% ▼	7,38%
-	16.108.768,64	0,00	0,00	15.424.234,07	-684.534,57	-4,25%	7,64%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	515.587,13	0,00	0,00	513.488,97	-2.098,16	-0,41% ▼	2,40%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.228.313,48	0,00	0,00	4.153.402,38	-74.911,10	-1,77% ▼	7,21%
-	4.743.900,61	0,00	0,00	4.666.891,35	-77.009,26	-1,62%	6,68%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	979.044,52	0,00	0,00	949.879,56	-29.164,96	-2,98% ▼	7,07%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.534.841,50	0,00	0,00	1.513.366,74	-21.474,76	-1,40% ▼	7,82%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.255.033,08	0,00	0,00	1.238.509,45	-16.523,63	-1,32% ▼	6,94%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	756.616,47	0,00	0,00	726.056,68	-30.559,79	-4,04% ▼	9,76%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.107.967,87	0,00	0,00	1.064.175,45	-43.792,42	-3,95% ▼	6,38%
	5.633.503,44	0,00	0,00	5.491.987,88	-141.515,56	-2,51%	6,23%

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

