

2023

Relatório Mensal

Julho

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	10.653.737,11	11,78%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	506.459,49	0,56%	5.898.923.569,05	0,01%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	539.625,53	0,60%	4.905.523.474,02	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	807.706,08	0,89%	978.255.076,45	0,08%	7º I b
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.311.141,28	2,56%	138.112.222,97	1,67%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	591.987,21	0,65%	5.462.057.088,14	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	720.003,75	0,80%	5.655.699.960,16	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.630.996,58	1,80%	8.226.261.315,96	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.946.669,55	14,32%	4.916.698.620,80	0,26%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.177.189,37	1,30%	7.409.323.495,01	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.921,67	0,04%	13.970.526.845,65	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.935.988,38	3,25%	2.143.764.034,65	0,14%	7º I b
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	729.259,78	0,81%	327.369.009,91	0,22%	7º I b
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.795.993,18	10,83%	711.904.762,31	1,38%	7º III a
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.956.863,17	4,38%	10.276.254.687,90	0,04%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.132.944,65	13,42%	142.854.709,37	8,49%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.279.650,18	1,42%	1.359.618.949,84	0,09%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	67.020,82	0,07%	2.886.944.335,56	0,00%	7º III a
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.640.480,41	1,81%	815.496.559,66	0,20%	8º I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.777.072,83	3,07%	296.674.844,32	0,94%	8º I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.947.829,83	2,15%	483.820.683,81	0,40%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	926.214,48	1,02%	1.488.990.199,10	0,06%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.365.156,96	3,72%	674.817.145,57	0,50%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.046.640,63	2,26%	238.987.102,27	0,86%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.269.187,33	1,40%	1.375.214.431,22	0,09%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.589.678,06	1,76%	1.835.519.637,65	0,09%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	788.745,91	0,87%	160.699.525,51	0,49%	8º I

Investimentos

\$ 90.422.775,77

Disponibilidades Financeiras

\$ 181.355,89

Total Carteira

\$ 90.604.131,66

Governança (Pró Gestão)

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	386.098,00	0,43%	432.633.286,62	0,09%	8º I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	211.501,51	0,23%	98.973.958,89	0,21%	8º I
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	989.202,00	1,09%	19.076.539,17	5,19%	9º II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	775.827,86	0,86%	662.986.244,95	0,12%	9º II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	1.127.099,81	1,25%	293.744.521,03	0,38%	9º II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.546.829,10	1,71%	2.066.727.306,72	0,07%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.235.453,17	1,37%	98.106.059,62	1,26%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	515.015,58	0,57%	1.577.035.964,16	0,03%	10º I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.466.584,52	4,94%	1.655.052.227,35	0,27%	10º I

Investimentos

\$ 90.422.775,77

Disponibilidades Financeiras

\$ 181.355,89

Total Carteira

\$ 90.604.131,66

Governança (Pró Gestão)

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	10/12/2021	Curva - Taxa: 5,0200%	29	4.473,763478	129.739,14
NTN-B - 15/05/2035	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,6800%	20	4.661,070865	93.221,42
NTN-B - 15/08/2040	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7500%	49	4.829,32277	236.636,82
NTN-B - 15/05/2045	26/03/2020	Curva - Taxa: 4,5500%	146	4.990,233899	728.574,15
NTN-B - 15/05/2045	09/09/2021	Curva - Taxa: 4,8600%	351	4.800,562113	1.684.997,30
NTN-B - 15/05/2045	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	72	4.860,604626	349.963,53
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2019	Curva - Taxa: 4,4000%	122	5.264,891981	642.316,82
NTN-B - 15/08/2050	31/03/2020	Curva - Taxa: 4,4600%	71	5.220,331532	370.643,54
NTN-B - 15/08/2050	02/04/2020	Curva - Taxa: 4,5900%	146	5.125,69783	748.351,88
NTN-B - 15/08/2050	06/04/2020	Curva - Taxa: 4,6800%	123	5.061,677516	622.586,33
NTN-B - 15/08/2050	08/04/2020	Curva - Taxa: 4,6300%	122	5.097,098101	621.845,97
NTN-B - 15/08/2050	09/04/2020	Curva - Taxa: 4,7300%	124	5.026,628303	623.301,91
NTN-B - 15/08/2050	15/05/2020	Curva - Taxa: 4,6400%	147	5.089,984274	748.227,69
NTN-B - 15/08/2050	23/11/2020	Curva - Taxa: 4,3400%	3	5.310,01774	15.930,05
NTN-B - 15/08/2050	10/03/2021	Curva - Taxa: 4,1500%	19	5.456,758985	103.678,42
NTN-B - 15/08/2050	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7800%	69	4.991,942208	344.444,01
NTN-B - 15/08/2050	15/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	29	4.323,671637	125.386,48
NTN-B - 15/05/2055	01/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	359	5.005,959417	1.797.139,43
NTN-B - 15/05/2055	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,8000%	134	4.975,762791	666.752,21

Investimentos

\$ 90.422.775,77

Disponibilidades Financeiras

\$ 181.355,89

Total Carteira

\$ 90.604.131,66

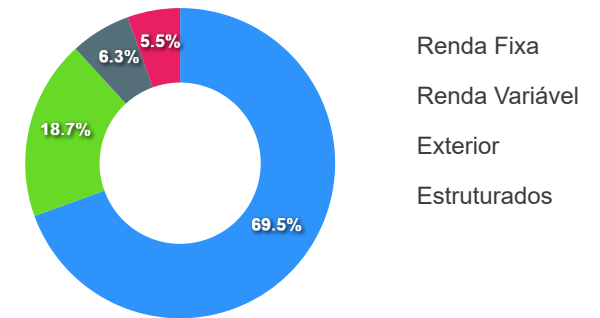
Governança (Pró Gestão)

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	11,76%	10.653.737,11 88,24%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	27,52%	24.931.948,67 72,48%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	30,06%	27.232.472,00 29,94%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	18,71%	16.948.605,95 11,29%
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,19%	2.892.129,67 6,81%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,07%	2.782.282,27 6,93%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	5,50%	4.981.600,10 4,50%

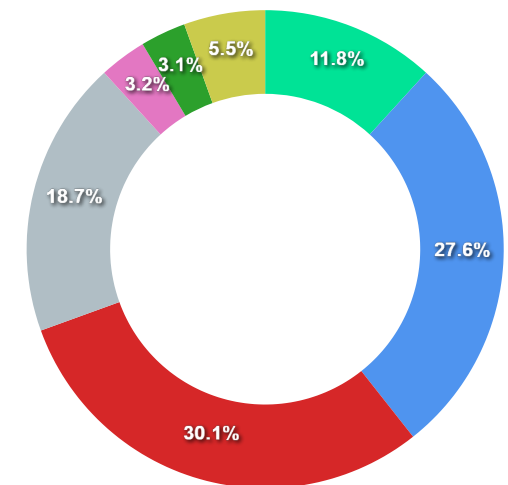
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos

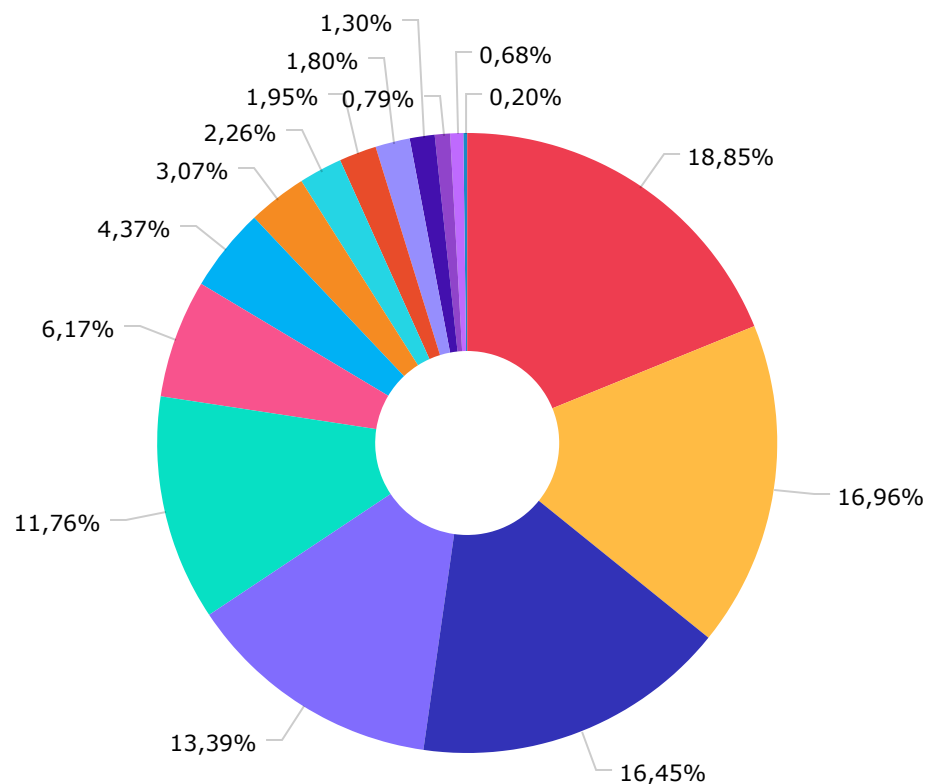


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	11,76%	0,00%	15,00%	100,00%	79.950.394,55	8º I - Fundos de Ações	18,71%	0,00%	28,00%	30,00%	10.232.633,55
7º I b - FI 100% Títulos TN	27,52%	0,00%	20,00%	100,00%	65.672.182,99	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	27.181.239,50
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	90.604.131,66	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	9.060.413,17
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.530.206,58	9º II - Constituídos no Brasil	3,19%	0,00%	2,00%	10,00%	6.168.283,50
7º III a - FI Referenciados RF	30,06%	0,00%	20,00%	60,00%	27.130.007,00	9º III - Ações - BDR Nível I	3,07%	0,00%	5,00%	10,00%	6.278.130,90
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	54.362.479,00	10º I - Fundos Multimercados	5,50%	0,00%	5,00%	10,00%	4.078.813,07
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	18.120.826,33	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.530.206,58
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.530.206,58	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.530.206,58
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.530.206,58	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.530.206,58
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.530.206,58	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.530.206,58

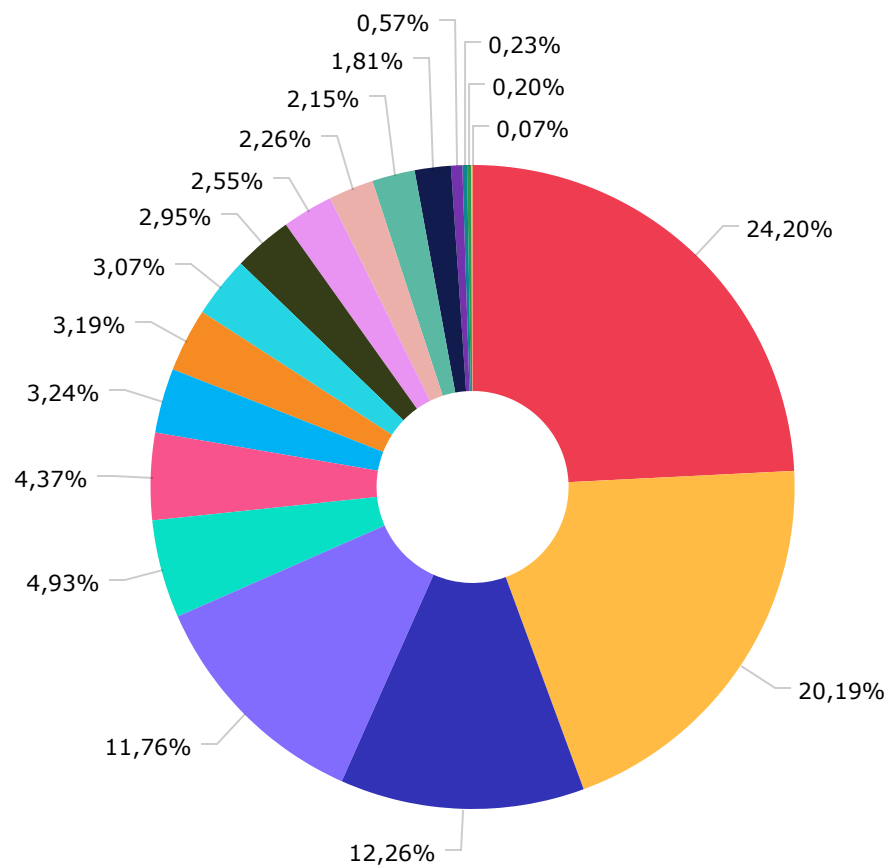
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25		
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,48	8,24	5,19	6,95	14,09	18,57	1,54	3,24
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13	7,58	3,51	6,46	13,70	25,13	0,02	0,04
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,05	7,66	3,44	6,47	13,55	24,37	0,03	0,06
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	2,13	17,59	8,68	12,66	8,57	-3,00		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,12	16,95	8,55	12,11	7,35	-4,52	5,49	11,57
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,81	1,12	2,23	1,06	-2,12	-3,21	4,45	9,37
IBOVESPA - BENCHMARK	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12		
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	3,22	11,16	16,77	7,50	18,30	0,03	8,00	16,84
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	3,19	10,26	16,92	7,19	16,54	-16,60	7,68	16,18
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	3,45	10,18	17,22	6,33	15,96	-4,59	7,97	16,79
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2,64	8,36	17,40	4,26	15,00	-4,88	7,36	15,50
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1,45	13,46	16,34	9,27	13,40	2,04	6,37	13,41
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3,04	11,34	19,10	7,56	13,17	-9,95	7,22	15,20
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	3,22	10,90	17,26	7,55	12,97	-16,04	7,22	15,20
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,06	9,92	21,12	5,03	11,27	-28,30	7,52	15,84
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,61	1,00	8,70	-1,38	9,73	-10,65	7,35	15,48
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4,56	8,65	18,56	4,23	3,94	-25,26	7,55	15,89
IDIV - BENCHMARK	2,84	12,41	12,81	6,16	18,72	18,15		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,66	11,34	12,19	5,35	17,08	14,38	6,76	14,24
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,98	7,84	2,26	6,31	10,55	21,73		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92	7,57	2,34	6,08	10,55	20,96	0,71	1,49

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B - BENCHMARK	0,81	12,27	5,83	12,27	15,46	19,21		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80	12,14	5,79	12,17	15,29	18,72	1,55	3,27
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,82	12,21	5,87	12,31	15,19	18,61	1,58	3,33
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73	12,10	5,78	12,11	15,14	18,55	1,54	3,25
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	0,81	11,70	5,59	11,69	15,05	19,15	1,53	3,23
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,97	8,08	2,62	6,60	11,29	22,46		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95	8,02	2,64	6,56	11,20	22,15	0,73	1,55
IMA-B 5+ - BENCHMARK	0,73	15,74	8,42	17,22	19,37	15,53		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,69	15,54	8,34	17,04	19,04	14,33	2,30	4,84
IPCA - BENCHMARK	0,12	2,99	0,27	2,45	3,99	14,46		
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,87	10,40	5,15	9,78	14,96	21,08	1,02	2,15
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,89	9,23	4,88	8,11	14,71	20,86	1,04	2,18
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79	9,61	4,54	8,91	14,14	21,06	0,49	1,02
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,90	11,27	5,57	10,71	13,06	23,97	1,15	2,43
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,79	8,60	4,20	7,59	13,04	21,18	1,07	2,26
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82	10,10	3,35	8,80	12,42		1,11	2,33
IRF-M 1 - BENCHMARK	1,07	7,81	3,44	6,64	13,84	23,07		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,07	7,73	3,39	6,53	13,63	22,57	0,16	0,33
SELIC - BENCHMARK	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25		
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,04	7,48	3,25	6,31	13,31	23,70	0,01	0,02
MSCI WORLD - BENCHMARK	1,62	6,99	2,45	2,31	1,97	-7,57		

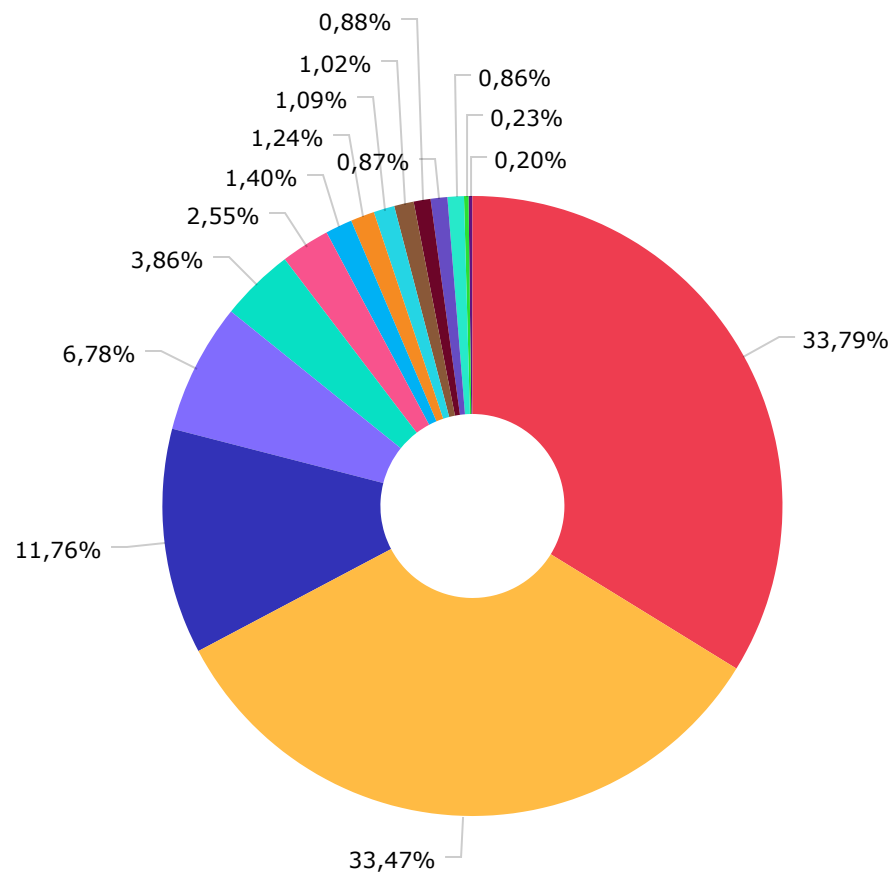
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	3,57	26,07	11,27	13,57	16,70	-28,42	7,80	16,44
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	0,68	-2,05	-2,59	-3,40	-3,81	-12,19	3,99	8,41
MSCI ACWI - BENCHMARK	1,88	6,14	2,36	1,41	1,33	-9,61		
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,64	24,55	12,24	16,92	20,80	22,16	3,74	7,89
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1,81	4,72	1,78	2,93	4,05	-10,02	6,18	13,02



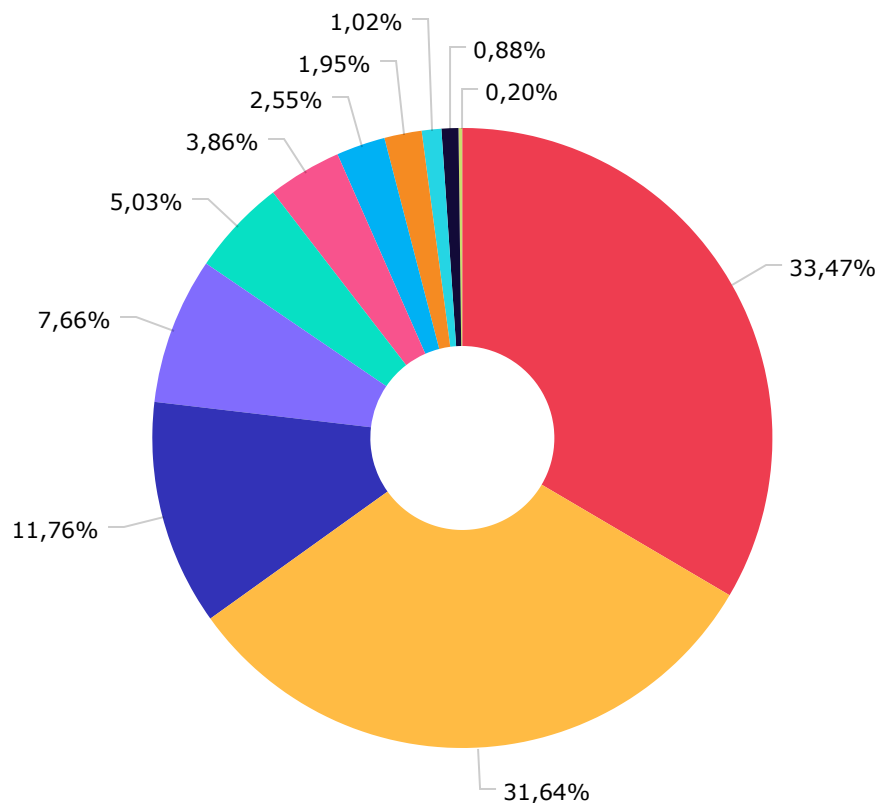
IMA-B	17.077.086,54
IPCA	15.367.394,12
Ibovespa	14.901.965,32
IMA-B 5+	12.132.944,65
Títulos Públicos	10.653.737,11
MSCI ACWI	5.593.684,33
Selic	3.956.863,17
Global BDRX	2.782.282,27
IDIV	2.046.640,63
MSCI WORLD	1.765.029,86
IMA-B 5	1.630.996,58
IRF-M 1	1.177.189,37
IDKA IPCA 2 Anos	720.003,75
CDI	616.958,07
Disponibilidades Financeiras	181.355,89



Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	21.928.937,83
Renda Fixa Indexados	18.294.134,96
Ações Livre	11.107.363,01
Títulos Públicos	10.653.737,11
Multimercados Livre	4.466.584,52
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	3.956.863,17
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	2.935.988,38
Ações Investimento no Exterior	2.892.129,67
Ações Indexados	2.777.072,83
Renda Fixa Duração Livre Soberano	2.670.334,23
Renda Fixa Duração Alta Soberano	2.311.141,28
Ações Dividendos	2.046.640,63
Ações Índice Ativo	1.947.829,83
Ações Sustentabilidade/Governança	1.640.480,41
Multimercados Macro	515.015,58
Ações Valor/Crescimento	211.501,51
Disponibilidades Financeiras	181.355,89
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	67.020,82



BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN...	30.610.703,66
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	30.321.645,10
TESOURO NACIONAL	10.653.737,11
ITAU UNIBANCO S.A.	6.147.217,61
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.494.271,51
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S....	2.311.141,28
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	1.269.187,33
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.127.099,81
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT B...	989.202,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	926.214,48
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	796.280,60
ITAÚ DTVM S.A.	788.745,91
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT...	775.827,86
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GEST...	211.501,51
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	181.355,89



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	30.321.645,10
BANCO BRADESCO S.A.	28.662.873,83
TESOURO NACIONAL	10.653.737,11
ITAU UNIBANCO S.A.	6.935.963,52
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	4.555.618,48
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.494.271,51
SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRI...	2.311.141,28
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	1.765.029,86
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	926.214,48
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	796.280,60
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	181.355,89

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%

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%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

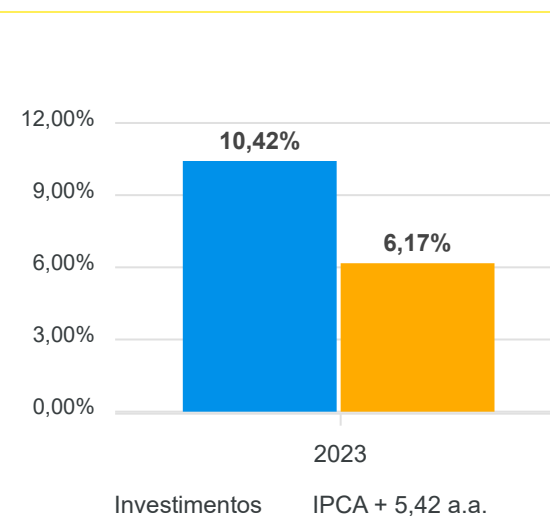


Gráfico Risco x Retorno

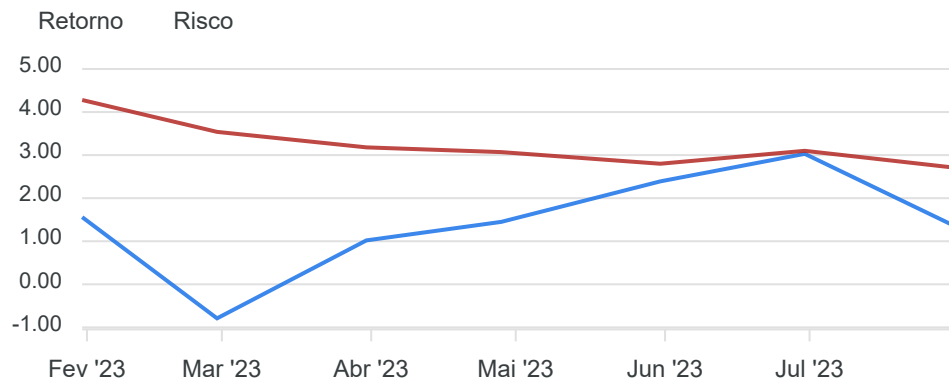
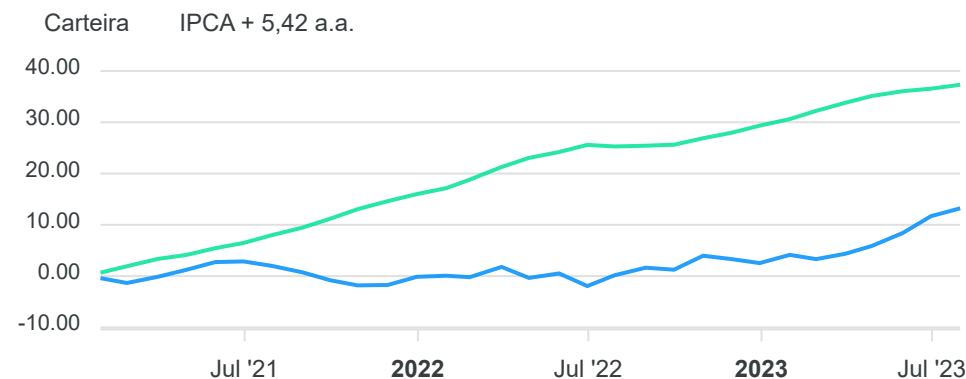
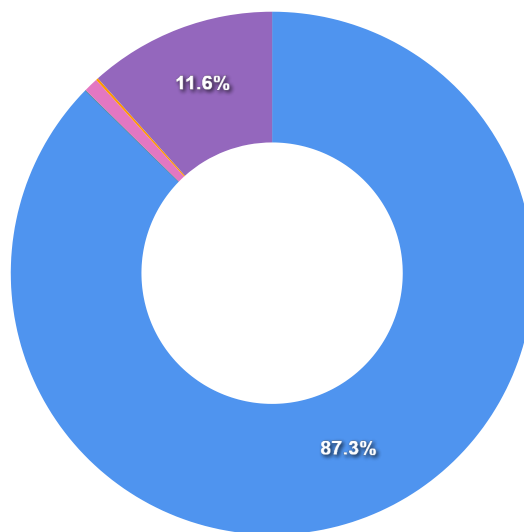


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/07/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	79.142.688,47	87,53
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	807.706,08	0,89
Até D+3600	129.739,14	0,14
Acima D+3600	10.523.997,97	11,64
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	10.612.654,39	0,00	0,00	10.653.737,11	41.082,72	0,39% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	502.506,92	0,00	0,00	506.459,49	3.952,57	0,79% ▲	0,49%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	535.697,18	0,00	0,00	539.625,53	3.928,35	0,73% ▲	1,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	801.145,37	0,00	0,00	807.706,08	6.560,71	0,82% ▲	1,11%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.292.672,82	0,00	0,00	2.311.141,28	18.468,46	0,81% ▲	1,53%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.711.851,21	0,00	0,00	9.795.993,18	84.141,97	0,87% ▲	1,02%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.707.248,74	210.304,52	0,00	3.956.863,17	39.309,91	1,00% ▲	0,01%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.049.321,59	0,00	0,00	12.132.944,65	83.623,06	0,69% ▲	2,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	586.747,30	0,00	0,00	591.987,21	5.239,91	0,89% ▲	1,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	713.467,10	0,00	0,00	720.003,75	6.536,65	0,92% ▲	0,71%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.615.622,42	0,00	0,00	1.630.996,58	15.374,16	0,95% ▲	0,73%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.843.727,10	0,00	0,00	12.946.669,55	102.942,45	0,80% ▲	1,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.164.711,38	0,00	0,00	1.177.189,37	12.477,99	1,07% ▲	0,16%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.560,31	0,00	0,00	34.921,67	361,36	1,05% ▲	0,03%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.269.197,36	0,00	0,00	1.279.650,18	10.452,82	0,82% ▲	1,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.909.855,31	0,00	0,00	2.935.988,38	26.133,07	0,90% ▲	1,15%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	723.554,87	0,00	0,00	729.259,78	5.704,91	0,79% ▲	1,07%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.171,32	494.736,08	430.000,00	67.020,82	1.113,42	0,22% ▲	0,02%
	62.075.712,69	705.040,60	430.000,00	62.818.157,78	467.404,49	0,75%	1,15%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.585.834,36	0,00	0,00	1.640.480,41	54.646,05	3,45% ▲	7,97%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	2.690.493,61	0,00	0,00	2.777.072,83	86.579,22	3,22% ▲	8,00%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	1.897.761,75	0,00	0,00	1.947.829,83	50.068,08	2,64% ▲	7,36%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	898.676,49	0,00	0,00	926.214,48	27.537,99	3,06% ▲	7,52%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.265.966,53	0,00	0,00	3.365.156,96	99.190,43	3,04% ▲	7,22%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.993.567,38	0,00	0,00	2.046.640,63	53.073,25	2,66% ▲	6,76%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.251.095,65	0,00	0,00	1.269.187,33	18.091,68	1,45% ▲	6,37%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.549.202,62	0,00	0,00	1.589.678,06	40.475,44	2,61% ▲	7,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	764.175,23	0,00	0,00	788.745,91	24.570,68	3,22% ▲	7,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	369.246,58	0,00	0,00	386.098,00	16.851,42	4,56% ▲	7,55%
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	204.956,34	0,00	0,00	211.501,51	6.545,17	3,19% ▲	7,68%
-	16.470.976,54	0,00	0,00	16.948.605,95	477.629,41	2,90%	7,36%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	507.519,93	0,00	0,00	515.015,58	7.495,65	1,48% ▲	1,54%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.309.701,05	0,00	0,00	4.466.584,52	156.883,47	3,64% ▲	3,74%
-	4.817.220,98	0,00	0,00	4.981.600,10	164.379,12	3,41%	3,51%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	982.488,58	0,00	0,00	989.202,00	6.713,42	0,68% ▲	3,99%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.514.779,74	0,00	0,00	1.546.829,10	32.049,36	2,12% ▲	5,49%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.213.450,59	0,00	0,00	1.235.453,17	22.002,58	1,81% ▲	4,45%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	749.082,32	0,00	0,00	775.827,86	26.745,54	3,57% ▲	7,80%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.107.042,11	0,00	0,00	1.127.099,81	20.057,70	1,81% ▲	6,18%
	5.566.843,34	0,00	0,00	5.674.411,94	107.568,60	1,93%	4,23%

Cenário Econômico

O mês de julho manteve o bom ritmo dos últimos meses e foi mais um que trouxe bons resultados para as carteiras de investimentos. A renda fixa fechou no positivo, mas com o desempenho inferior aos que estávamos acompanhando nos meses anteriores, principalmente pelos fundos atrelados a inflação, que tiveram um despenho mais fraco em relação aos últimos meses, por conta da redução da magnitude do fechamento da curva de juros. Na renda variável, os fundos também tiveram um desempenho positivo, mas inferior aos meses anteriores. E por fim os fundos de investimentos no exterior fecharam no positivo, mesmo com a valorização do real frente ao dólar, refletindo o bom desempenho dos ativos no exterior, e seguindo uma temporada de balanços das empresas sem surpresas.

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, a continuidade do fechamento em curso da curva de juros, manteve o quadro de bons retornos nas estratégias CDI e IMA's. Da mesma forma, os Títulos Públicos Federais seguem apresentando remuneração competitiva, embora a janela de aquisição esteja próxima do fim, já que as remunerações dos ativos apesar de ainda superiores a média das metas atuariais, já estão distantes das máximas atingidas. Na renda variável, o mês foi bastante positivo, acompanhando as projeções de mercado que continuam sinalizando para um IBOVESPA próximo de 130 mil pontos ao final de 2023. Da mesma forma, os fundos de investimentos no exterior fecharam no positivo, mesmo com a valorização do real frente ao dólar, refletindo o bom desempenho dos ativos no exterior, e seguindo uma temporada de balanços das empresas sem surpresas.

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 agosto de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

