

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
TÍTULOS PÚBLICOS	10.658.599,59	11,90%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	516.216,50	0,58%	6.050.581.610,41	0,01%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	532.252,72	0,59%	5.367.605.963,99	0,01%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	807.664,24	0,90%	979.392.694,65	0,08%	7º I b
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.281.776,76	2,55%	179.430.920,95	1,27%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	598.126,55	0,67%	5.614.661.167,38	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	728.161,71	0,81%	5.412.384.350,74	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.642.571,25	1,83%	8.162.684.334,70	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.901.109,86	14,41%	5.222.821.325,49	0,25%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.201.085,99	1,34%	7.513.988.203,57	0,02%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	35.652,39	0,04%	13.380.727.353,70	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.938.042,77	3,28%	2.195.169.805,31	0,13%	7º I b
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	757.203,18	0,85%	338.304.183,45	0,22%	7º I b
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.865.071,06	11,02%	720.074.390,87	1,37%	7º III a
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.159.433,15	4,64%	10.855.711.641,60	0,04%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.173.333,20	13,59%	152.854.490,27	7,96%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.262.547,68	1,41%	1.357.142.226,13	0,09%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.796,45	0,01%	2.788.665.794,77	0,00%	7º III a
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.569.218,72	1,75%	762.055.294,68	0,21%	8º I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.655.547,10	2,97%	265.091.830,29	1,00%	8º I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.807.194,27	2,02%	431.844.819,05	0,42%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	865.033,14	0,97%	1.378.562.754,92	0,06%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.206.096,43	3,58%	628.673.074,03	0,51%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.013.669,64	2,25%	233.814.811,38	0,86%	8º I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.195.294,41	1,33%	1.281.232.542,36	0,09%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.507.968,84	1,68%	1.645.975.612,64	0,09%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	738.504,52	0,82%	150.463.327,60	0,49%	8º I

Investimentos

\$ 89.550.817,74

Disponibilidades Financeiras

\$ 199.336,85

Total Carteira

\$ 89.750.154,59

Governança (Pró Gestão)

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	349.741,38	0,39%	335.448.610,10	0,10%	8º I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	200.500,19	0,22%	74.482.220,87	0,27%	8º I
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	979.044,52	1,09%	15.890.558,35	6,16%	9º II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	756.616,47	0,84%	634.297.137,32	0,12%	9º II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	1.107.967,87	1,24%	288.512.148,38	0,38%	9º II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.534.841,50	1,71%	1.999.422.357,55	0,08%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.255.033,08	1,40%	94.904.979,67	1,32%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	515.587,13	0,58%	1.516.685.306,19	0,03%	10º I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.228.313,48	4,72%	1.537.651.847,22	0,27%	10º I

Investimentos

\$ 89.550.817,74

Disponibilidades Financeiras

\$ 199.336,85

Total Carteira

\$ 89.750.154,59

Governança (Pró Gestão)

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	10/12/2021	Curva - Taxa: 5,0200%	29	4.409,297163	127.869,62
NTN-B - 15/05/2035	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,6800%	20	4.719,787807	94.395,76
NTN-B - 15/08/2040	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7500%	49	4.767,427715	233.603,96
NTN-B - 15/05/2045	26/03/2020	Curva - Taxa: 4,5500%	146	5.052,02341	737.595,42
NTN-B - 15/05/2045	09/09/2021	Curva - Taxa: 4,8600%	351	4.862,458781	1.706.723,03
NTN-B - 15/05/2045	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	72	4.922,474037	354.418,13
NTN-B - 15/08/2050	29/03/2019	Curva - Taxa: 4,4000%	122	5.205,539915	635.075,87
NTN-B - 15/08/2050	31/03/2020	Curva - Taxa: 4,4600%	71	5.160,951349	366.427,55
NTN-B - 15/08/2050	02/04/2020	Curva - Taxa: 4,5900%	146	5.066,239514	739.670,97
NTN-B - 15/08/2050	06/04/2020	Curva - Taxa: 4,6800%	123	5.002,161329	615.265,84
NTN-B - 15/08/2050	08/04/2020	Curva - Taxa: 4,6300%	122	5.037,612452	614.588,72
NTN-B - 15/08/2050	09/04/2020	Curva - Taxa: 4,7300%	124	4.967,075041	615.917,31
NTN-B - 15/08/2050	15/05/2020	Curva - Taxa: 4,6400%	147	5.030,494036	739.482,62
NTN-B - 15/08/2050	23/11/2020	Curva - Taxa: 4,3400%	3	5.250,696462	15.752,09
NTN-B - 15/08/2050	10/03/2021	Curva - Taxa: 4,1500%	19	5.397,517427	102.552,83
NTN-B - 15/08/2050	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,7800%	69	4.932,353586	340.332,40
NTN-B - 15/08/2050	15/08/2022	Curva - Taxa: 5,8600%	29	4.263,060762	123.628,76
NTN-B - 15/05/2055	01/09/2021	Curva - Taxa: 4,7600%	359	5.069,680565	1.820.015,32
NTN-B - 15/05/2055	10/09/2021	Curva - Taxa: 4,8000%	134	5.039,428332	675.283,40

Investimentos

\$ 89.550.817,74

Disponibilidades Financeiras

\$ 199.336,85

Total Carteira

\$ 89.750.154,59

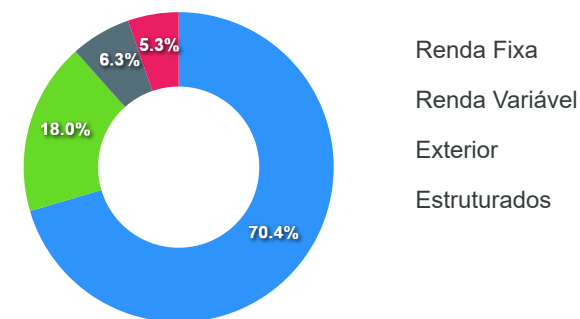
Governança (Pró Gestão)

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	11,88%	10.658.599,59 88,12%
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	27,79%	24.939.863,92 72,21%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	30,60%	27.466.181,54 29,40%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	17,95%	16.108.768,64 12,05%
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,17%	2.843.628,86 6,83%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,11%	2.789.874,58 6,89%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	5,29%	4.743.900,61 4,71%

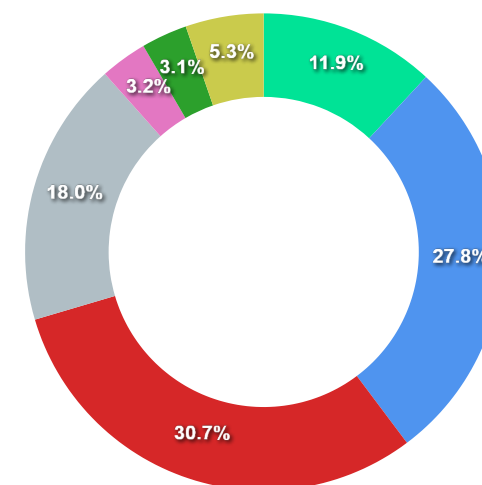
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos

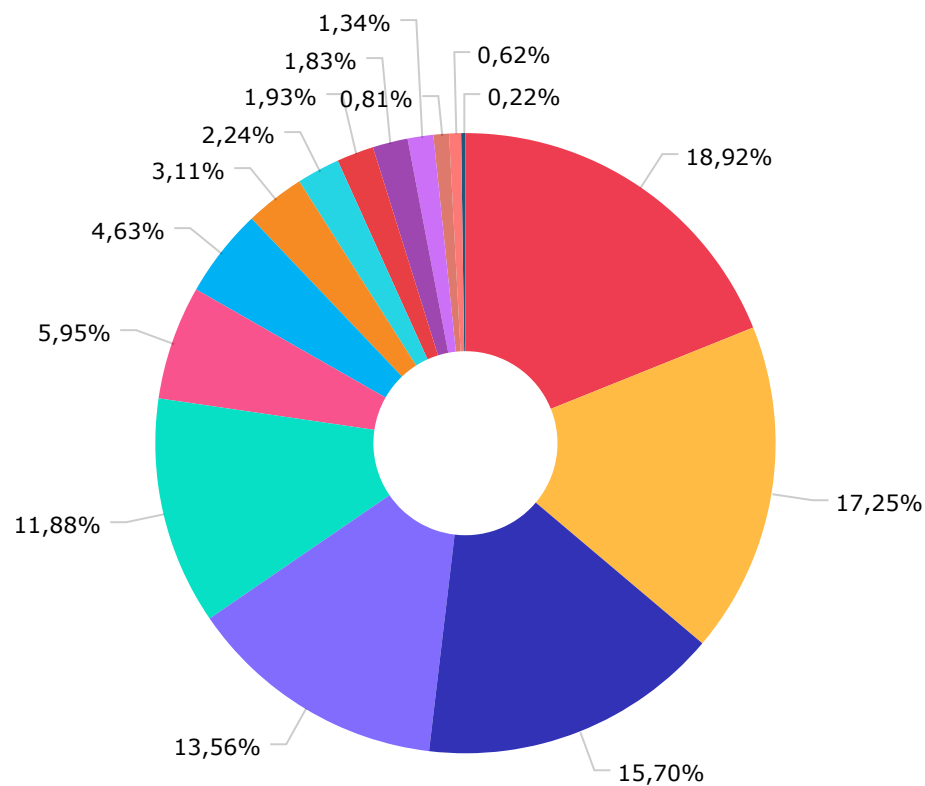


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	11,88%	0,00%	15,00%	100,00%	79.091.555,00	8º I - Fundos de Ações	17,95%	0,00%	28,00%	30,00%	10.816.277,74
7º I b - FI 100% Títulos TN	27,79%	0,00%	20,00%	100,00%	64.810.290,67	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	26.925.046,38
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	89.750.154,59	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	8.975.015,46
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.487.507,73	9º II - Constituídos no Brasil	3,17%	0,00%	2,00%	10,00%	6.131.386,60
7º III a - FI Referenciados RF	30,60%	0,00%	20,00%	60,00%	26.383.911,21	9º III - Ações - BDR Nível I	3,11%	0,00%	5,00%	10,00%	6.185.140,88
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	53.850.092,75	10º I - Fundos Multimercados	5,29%	0,00%	5,00%	10,00%	4.231.114,85
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	17.950.030,92	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.487.507,73
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.487.507,73	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.487.507,73
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.487.507,73	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.487.507,73
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.487.507,73	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.487.507,73

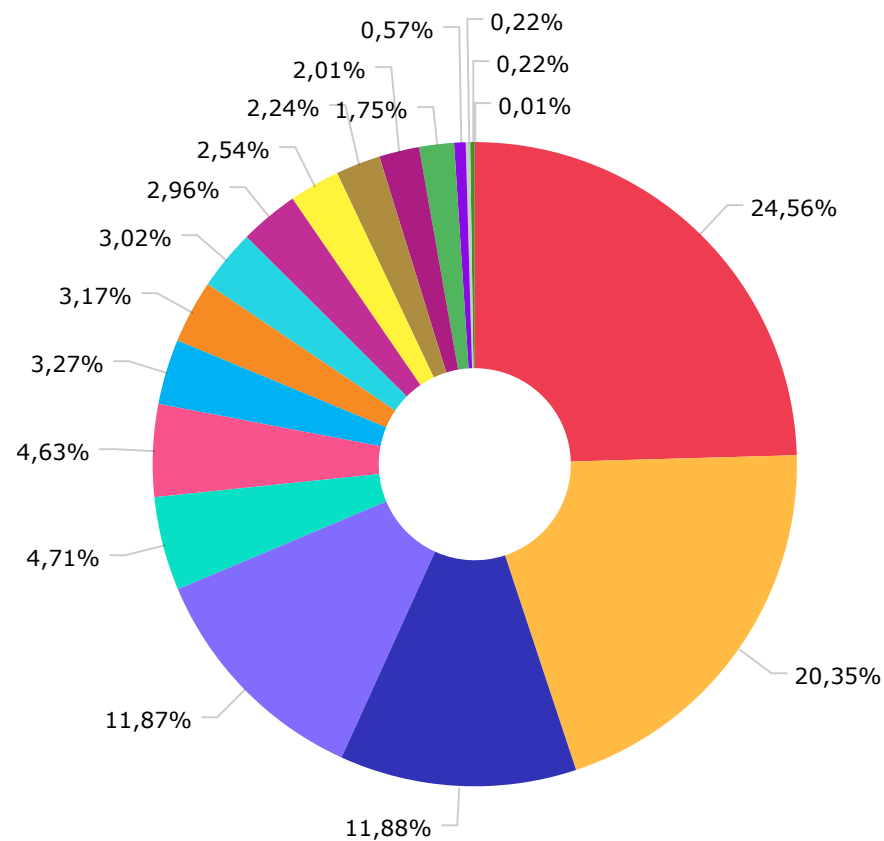
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80		
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,02	10,12	3,52	6,89	13,72	26,84	0,01	0,03
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95	9,91	3,16	6,49	13,34	25,92	0,03	0,06
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,50	8,36	1,59	6,08	10,18	21,24	1,92	4,04
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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,00	2,72	3,43	5,44	9,64	-5,49	4,96	10,46
IBOVESPA - BENCHMARK	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03		
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	0,70	6,29	-1,30	14,45	6,06	5,06	7,54	15,88
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	0,90	5,40	-1,05	14,24	4,22	1,06	7,77	16,37
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	0,48	4,53	-2,17	13,09	3,71	-11,31	7,44	15,66
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,01	6,08	-1,83	14,98	1,58	-6,59	7,55	15,91
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,00	6,85	-4,46	12,85	1,02	4,21	7,67	16,16
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-0,96	0,53	-4,77	8,93	-0,40	-1,54	8,76	18,44
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-0,74	3,84	-3,36	12,23	-0,73	-12,46	7,60	16,00
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,20	-4,19	-2,66	4,48	-1,31	-7,29	5,34	11,24
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,62	2,66	-3,74	10,79	-1,41	-21,17	8,11	17,08
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-0,53	-1,58	-5,28	9,42	-11,12	-23,18	9,63	20,28
IDIV - BENCHMARK	1,32	10,67	1,25	15,38	14,16	22,39		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,25	9,55	1,01	14,44	12,73	19,59	6,11	12,86
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,29	8,97	2,05	4,08	11,42	21,35		
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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA-B - BENCHMARK	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09		
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,91	10,28	-0,48	6,21	10,96	18,80	2,48	5,22
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
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
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88		
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,96	11,82	-2,55	8,00	9,82	14,81	4,04	8,51
IPCA - BENCHMARK	0,26	3,50	0,61	1,38	5,19	12,73		
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88	11,72	2,73	7,91	13,59	23,82	0,14	0,30
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,14	11,18	1,58	7,35	12,82	22,74	0,98	2,06
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40	10,36	1,94	6,89	12,82	23,47	0,60	1,26
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40	10,09	0,81	4,72	11,34		1,47	3,09
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,19	9,05	1,21	5,61	11,22	21,04	0,85	1,79
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,30	11,35	0,97	6,94	10,76	22,65	1,61	3,38
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		
BRADERCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,96	9,73	3,15	6,34	13,18	25,21	0,01	0,02
MSCI WORLD - BENCHMARK	-2,78	5,21	-0,07	0,75	11,10	-12,63		

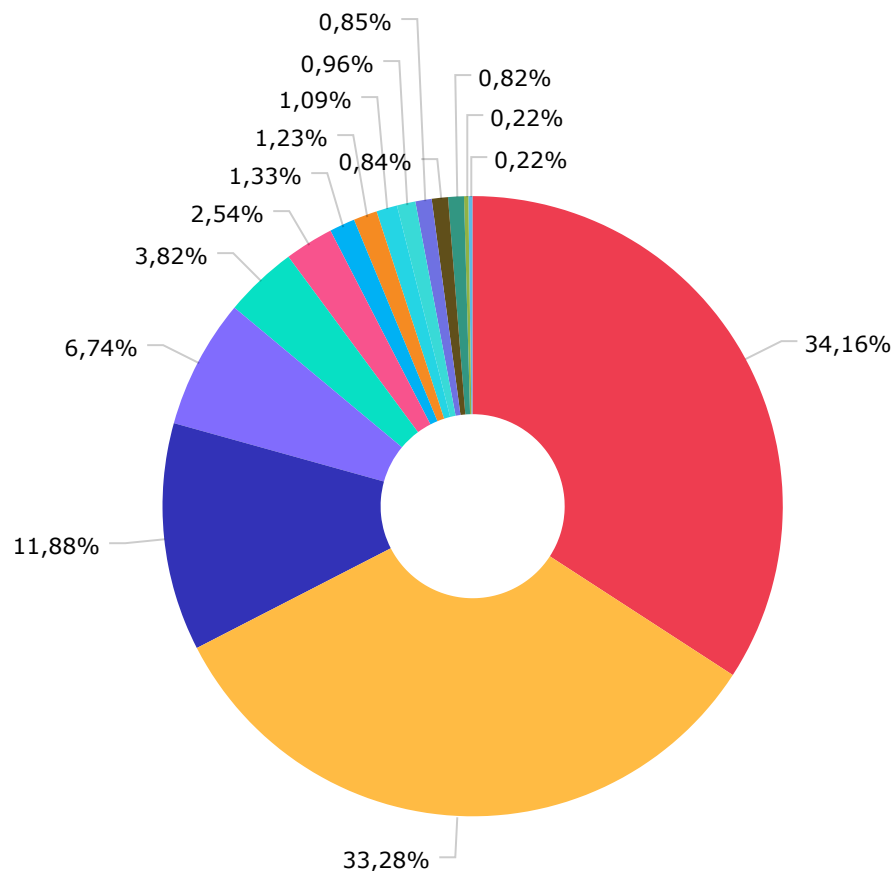
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-3,77	22,95	1,01	6,67	25,17	-31,61	7,97	16,78
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	-1,66	-3,06	-0,35	-3,06	4,60	-14,20	2,80	5,90
MSCI ACWI - BENCHMARK	-2,61	4,13	-0,05	0,10	9,93	-14,78		
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,46	17,90	-1,89	8,34	29,34	17,35	5,00	10,53
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-2,96	2,95	0,08	-0,04	13,53	-14,54	5,59	11,77



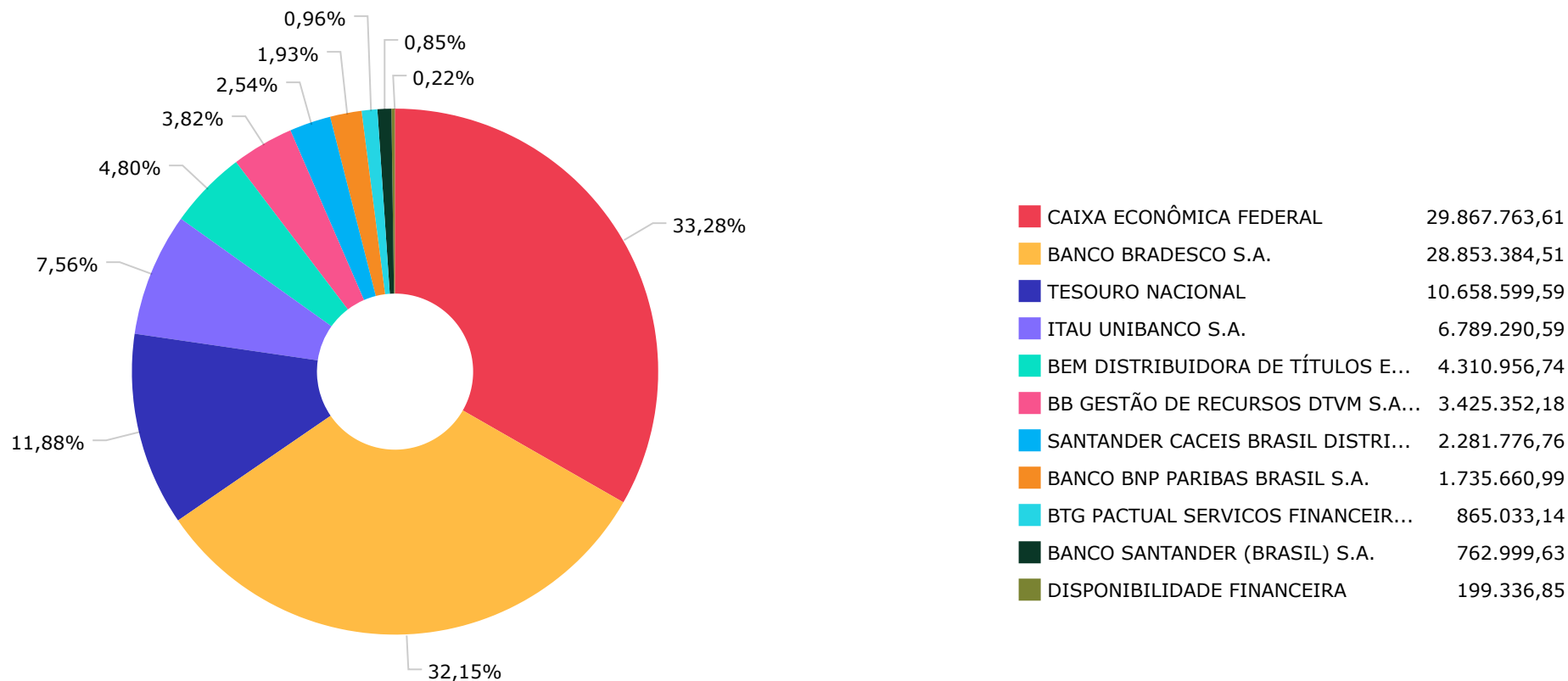
IMA-B	16.977.687,02
IPCA	15.482.324,30
Ibovespa	14.095.099,00
IMA-B 5+	12.173.333,20
Títulos Públicos	10.658.599,59
MSCI ACWI	5.336.281,35
Selic	4.159.433,15
Global BDRX	2.789.874,58
IDIV	2.013.669,64
MSCI WORLD	1.735.660,99
IMA-B 5	1.642.571,25
IRF-M 1	1.201.085,99
IDKA IPCA 2 Anos	728.161,71
CDI	557.035,97
Disponibilidades Financeiras	199.336,85



Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	22.038.404,26
Renda Fixa Indexados	18.267.729,21
Títulos Públicos	10.658.599,59
Ações Livre	10.652.513,30
Multimercados Livre	4.228.313,48
Renda Fixa Duração Baixa Soberano	4.159.433,15
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	2.938.042,77
Ações Investimento no Exterior	2.843.628,86
Renda Fixa Duração Livre Soberano	2.714.862,86
Ações Indexados	2.655.547,10
Renda Fixa Duração Alta Soberano	2.281.776,76
Ações Dividendos	2.013.669,64
Ações Índice Ativo	1.807.194,27
Ações Sustentabilidade/Governança	1.569.218,72
Multimercados Macro	515.587,13
Ações Valor/Crescimento	200.500,19
Disponibilidades Financeiras	199.336,85
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	5.796,45



BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEN...	30.660.578,78
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.867.763,61
TESOURO NACIONAL	10.658.599,59
ITAU UNIBANCO S.A.	6.050.786,07
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	3.425.352,18
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL S....	2.281.776,76
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS LTDA.	1.195.294,41
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.107.967,87
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT B...	979.044,52
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	865.033,14
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	762.999,63
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT...	756.616,47
ITAÚ DTVM S.A.	738.504,52
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS GEST...	200.500,19
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	199.336,85



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%

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

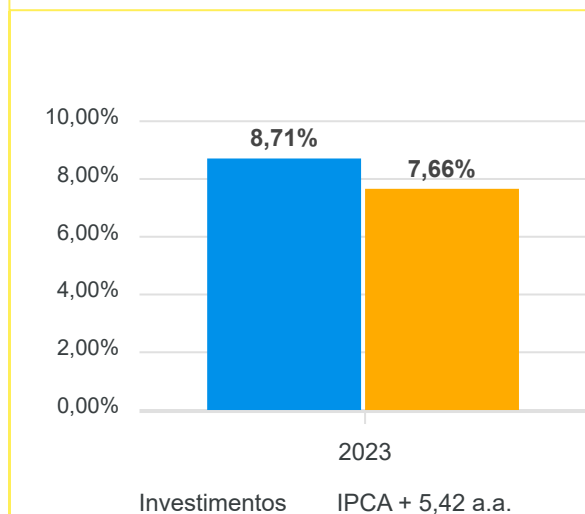


Gráfico Risco x Retorno

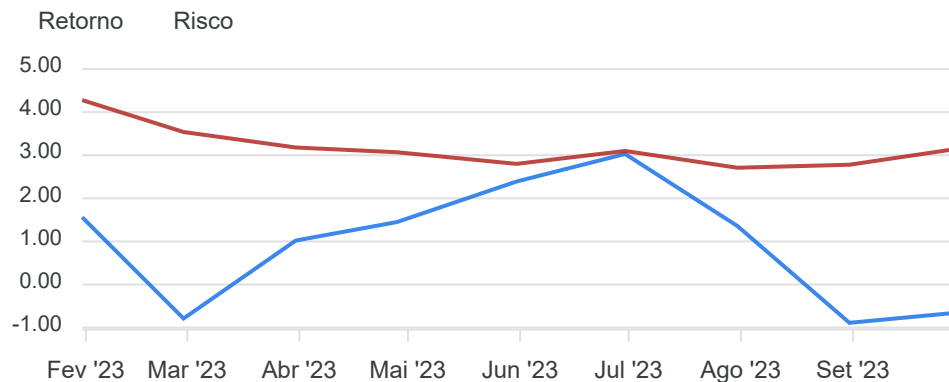
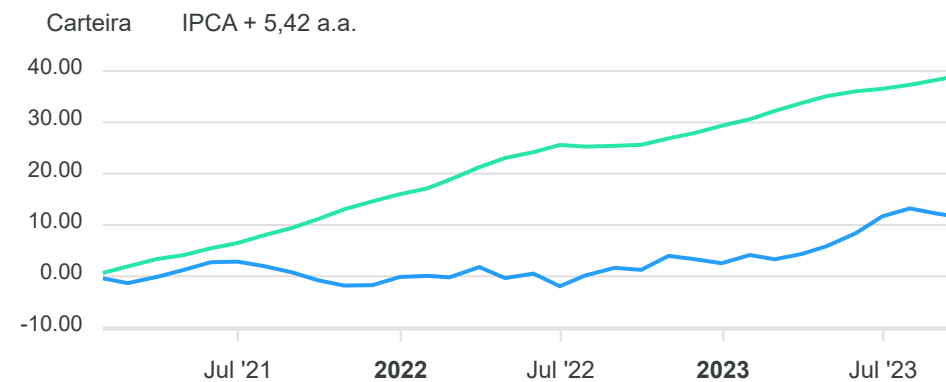
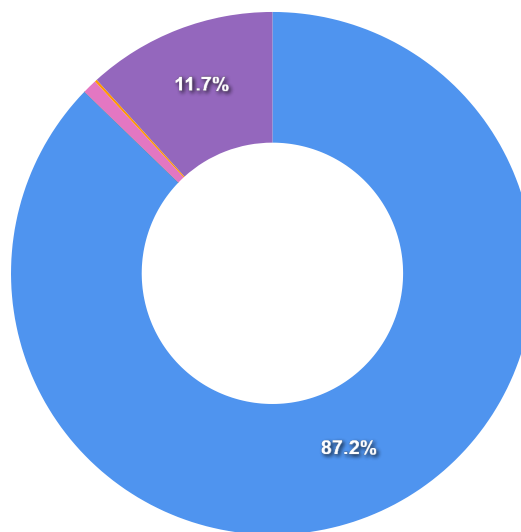


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 29/09/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	78.283.890,76	87,42
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	0,00	0,00
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	807.664,24	0,90
Até D+3600	127.869,62	0,14
Acima D+3600	10.530.729,97	11,76
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	10.593.465,74	0,00	0,00	10.658.599,59	65.133,85	0,61% ▲	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	511.721,88	0,00	0,00	516.216,50	4.494,62	0,88% ▲	0,14%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	537.460,16	0,00	0,00	532.252,72	-5.207,44	-0,97% ▼	2,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	810.939,64	0,00	0,00	807.664,24	-3.275,40	-0,40% ▼	1,47%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.302.741,45	0,00	0,00	2.281.776,76	-20.964,69	-0,91% ▼	2,48%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.851.489,44	0,00	0,00	9.865.071,06	13.581,62	0,14% ▲	0,98%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.001.535,38	119.000,00	0,00	4.159.433,15	38.897,77	0,94% ▲	0,01%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.416.530,63	0,00	0,00	12.173.333,20	-243.197,43	-1,96% ▼	4,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	595.720,85	0,00	0,00	598.126,55	2.405,70	0,40% ▲	0,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	725.579,64	0,00	0,00	728.161,71	2.582,07	0,36% ▲	0,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.640.735,07	0,00	0,00	1.642.571,25	1.836,18	0,11% ▲	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.025.775,43	0,00	0,00	12.901.109,86	-124.665,57	-0,96% ▼	2,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.190.263,90	0,00	0,00	1.201.085,99	10.822,09	0,91% ▲	0,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	35.315,63	0,00	0,00	35.652,39	336,76	0,95% ▲	0,03%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.275.236,31	0,00	0,00	1.262.547,68	-12.688,63	-1,00% ▼	2,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.946.860,07	0,00	0,00	2.938.042,77	-8.817,30	-0,30% ▼	1,61%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	755.793,00	0,00	0,00	757.203,18	1.410,18	0,19% ▲	0,85%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.673,98	63.750,27	60.000,00	5.796,45	372,20	0,57% ▲	0,01%
	63.218.838,20	182.750,27	60.000,00	63.064.645,05	-276.943,42	-0,44%	1,76%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES	1.555.187,83	0,00	0,00	1.569.218,72	14.030,89	0,90% ▲	7,77%
BRADERCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	2.636.978,96	0,00	0,00	2.655.547,10	18.568,14	0,70% ▲	7,54%
BRADERCO SELECTION FIAÇÕES	1.824.729,82	0,00	0,00	1.807.194,27	-17.535,55	-0,96% ▼	8,76%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	859.672,45	0,00	0,00	865.033,14	5.360,69	0,62% ▲	8,11%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.206.317,73	0,00	0,00	3.206.096,43	-221,30	-0,01% ▼	7,55%
CAIXA DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.988.724,63	0,00	0,00	2.013.669,64	24.945,01	1,25% ▲	6,11%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.207.403,51	0,00	0,00	1.195.294,41	-12.109,10	-1,00% ▼	7,67%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.511.033,29	0,00	0,00	1.507.968,84	-3.064,45	-0,20% ▼	5,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	743.995,26	0,00	0,00	738.504,52	-5.490,74	-0,74% ▼	7,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	351.594,50	0,00	0,00	349.741,38	-1.853,12	-0,53% ▼	9,63%
SULAMÉRICA EQUITIES FIAÇÕES	199.541,50	0,00	0,00	200.500,19	958,69	0,48% ▲	7,44%
-	16.085.179,48	0,00	0,00	16.108.768,64	23.589,16	0,15%	7,40%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	513.026,68	0,00	0,00	515.587,13	2.560,45	0,50% ▲	1,92%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.425.635,17	0,00	0,00	4.228.313,48	-197.321,69	-4,46% ▼	5,00%
-	4.938.661,85	0,00	0,00	4.743.900,61	-194.761,24	-3,94%	4,67%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	995.593,79	0,00	0,00	979.044,52	-16.549,27	-1,66% ▼	2,80%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.591.744,54	0,00	0,00	1.534.841,50	-56.903,04	-3,57% ▼	4,97%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.267.733,21	0,00	0,00	1.255.033,08	-12.700,13	-1,00% ▼	4,96%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	786.269,26	0,00	0,00	756.616,47	-29.652,79	-3,77% ▼	7,97%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.141.792,42	0,00	0,00	1.107.967,87	-33.824,55	-2,96% ▼	5,59%
	5.783.133,22	0,00	0,00	5.633.503,44	-149.629,78	-2,59%	4,02%

RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	502.506,92	0,00	0,00	516.216,50	13.709,58	2,73% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	535.697,18	0,00	0,00	532.252,72	-3.444,46	-0,64% ▼
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	801.145,37	0,00	0,00	807.664,24	6.518,87	0,81% ▲
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2.292.672,82	0,00	0,00	2.281.776,76	-10.896,06	-0,48% ▼
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.711.851,21	0,00	0,00	9.865.071,06	153.219,85	1,58% ▲
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.707.248,74	329.304,52	0,00	4.159.433,15	122.879,89	3,04% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.049.321,59	450.300,00	0,00	12.173.333,20	-326.288,39	-2,61% ▼
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	586.747,30	0,00	0,00	598.126,55	11.379,25	1,94% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	713.467,10	0,00	0,00	728.161,71	14.694,61	2,06% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.615.622,42	0,00	0,00	1.642.571,25	26.948,83	1,67% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.843.727,10	128.557,77	0,00	12.901.109,86	-71.175,01	-0,55% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.164.711,38	0,00	0,00	1.201.085,99	36.374,61	3,12% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.560,31	0,00	0,00	35.652,39	1.092,08	3,16% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.269.197,36	0,00	0,00	1.262.547,68	-6.649,68	-0,52% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.909.855,31	0,00	0,00	2.938.042,77	28.187,46	0,97% ▲
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	723.554,87	24.940,87	0,00	757.203,18	8.707,44	1,16% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.171,32	627.803,19	626.140,34	5.796,45	2.962,28	0,47% ▲
TÍTULOS PÚBLICOS	10.612.654,39	0,00	128.557,77	10.658.599,59	174.502,97	1,64% ▲
	62.075.712,69	1.560.906,35	754.698,11	63.064.645,05	182.724,12	0,29%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.585.834,36	0,00	0,00	1.569.218,72	-16.615,64	-1,05% ▼
BRADERCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.690.493,61	0,00	0,00	2.655.547,10	-34.946,51	-1,30% ▼
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	1.897.761,75	0,00	0,00	1.807.194,27	-90.567,48	-4,77% ▼
BIG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	898.676,49	0,00	0,00	865.033,14	-33.643,35	-3,74% ▼
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.265.966,53	0,00	0,00	3.206.096,43	-59.870,10	-1,83% ▼
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.993.567,38	0,00	0,00	2.013.669,64	20.102,26	1,01% ▲
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.251.095,65	0,00	0,00	1.195.294,41	-55.801,24	-4,46% ▼
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.549.202,62	0,00	0,00	1.507.968,84	-41.233,78	-2,66% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	764.175,23	0,00	0,00	738.504,52	-25.670,71	-3,36% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	369.246,58	0,00	0,00	349.741,38	-19.505,20	-5,28% ▼
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	204.956,34	0,00	0,00	200.500,19	-4.456,15	-2,17% ▼
	16.470.976,54	0,00	0,00	16.108.768,64	-362.207,90	-2,20%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	507.519,93	0,00	0,00	515.587,13	8.067,20	1,59% ▲
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.309.701,05	0,00	0,00	4.228.313,48	-81.387,57	-1,89% ▼
	4.817.220,98	0,00	0,00	4.743.900,61	-73.320,37	-1,52%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
ACCESS EQUITY WORLD SUSTENTÁVEL IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	982.488,58	0,00	0,00	979.044,52	-3.444,06	-0,35% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.514.779,74	0,00	0,00	1.534.841,50	20.061,76	1,32% ▲
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.213.450,59	0,00	0,00	1.255.033,08	41.582,49	3,43% ▲
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	749.082,32	0,00	0,00	756.616,47	7.534,15	1,01% ▲
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1.107.042,11	0,00	0,00	1.107.967,87	925,76	0,08% ▲
	5.566.843,34	0,00	0,00	5.633.503,44	66.660,10	1,20%

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

