

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	8.486.269,74	11,31%	0,00		7º I a
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.621.089,72	4,83%	1.516.152.288,42	0,24%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.788.499,83	10,38%	5.367.605.963,99	0,15%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	227.448,84	0,30%	188.464.404,15	0,12%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.118.445,65	2,82%	3.520.695.315,59	0,06%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.215.741,05	1,62%	8.162.684.334,70	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.738.182,14	10,31%	2.124.960.940,76	0,36%	7º I b
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2.047.141,29	2,73%	460.466.276,94	0,44%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.445.711,28	1,93%	3.380.807.738,12	0,04%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.186.849,35	5,58%	15.259.689.366,93	0,03%	7º III a
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1.749.255,39	2,33%	935.876.857,53	0,19%	7º III a
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.190.677,08	4,25%	8.906.699.435,49	0,04%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.276.600,87	1,70%	14.368.447.188,06	0,01%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	6.965.040,07	9,28%	1.357.142.226,13	0,51%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.885.331,28	2,51%	2.788.665.794,77	0,07%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.123.949,92	1,50%	610.972.724,31	0,18%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	883.920,07	1,18%	1.247.653.218,33	0,07%	8º I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.712.381,47	2,28%	809.353.434,17	0,21%	8º I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.152.838,13	2,87%	762.055.294,68	0,28%	8º I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	873.900,04	1,16%	326.355.916,88	0,27%	8º I
BRABESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	374.007,48	0,50%	521.061.013,74	0,07%	8º I
BRABESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.080.255,78	1,44%	679.097.352,39	0,16%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.713.797,03	2,28%	416.879.369,35	0,41%	8º I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.377.579,74	1,84%	936.050.590,14	0,15%	8º I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.256.198,74	1,67%	663.711.120,80	0,19%	8º I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	196.379,07	0,26%	643.763.945,61	0,03%	8º I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	502.541,52	0,67%	224.194.654,62	0,22%	8º I

Investimentos

\$ 75.048.029,09

Disponibilidades Financeiras

\$ 45.738,71

Total Carteira

\$ 75.093.767,80

Governança (Pró Gestão)
 NIVEL 2 15/02/2025

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	374.776,49	0,50%	114.550.251,73	0,33%	8º I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	923.862,93	1,23%	631.562.221,18	0,15%	9º III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	739.992,70	0,99%	446.292.351,73	0,17%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.141.298,18	5,52%	1.999.422.357,55	0,21%	9º III
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1.678.066,22	2,24%	45.643.401,32	3,68%	10º I

Investimentos

\$ 75.048.029,09


Disponibilidades Financeiras

\$ 45.738,71

Total Carteira

\$ 75.093.767,80

Governança (Pró Gestão)

 NIVEL 2 15/02/2025

Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2030	09/11/2021	Curva - Taxa: 5,2500%	250	4.354,484942	1.088.621,24
NTN-B - 15/08/2040	09/11/2021	Curva - Taxa: 5,2800%	250	4.507,081069	1.126.770,27
NTN-B - 15/08/2040	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,4900%	240	4.409,334475	1.058.240,27
NTN-B - 15/05/2045	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6000%	25	4.449,615508	111.240,39
NTN-B - 15/05/2045	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6000%	200	4.449,615508	889.923,10
NTN-B - 15/08/2050	05/11/2021	Curva - Taxa: 5,2400%	240	4.629,18865	1.111.005,28
NTN-B - 15/08/2050	01/04/2022	Curva - Taxa: 5,6000%	240	4.411,038418	1.058.649,22
NTN-B - 15/08/2050	15/07/2022	Curva - Taxa: 6,3200%	508	4.019,330664	2.041.819,98

Investimentos


\$ 75.048.029,09

Disponibilidades Financeiras

\$ 45.738,71

Total Carteira

\$ 75.093.767,80

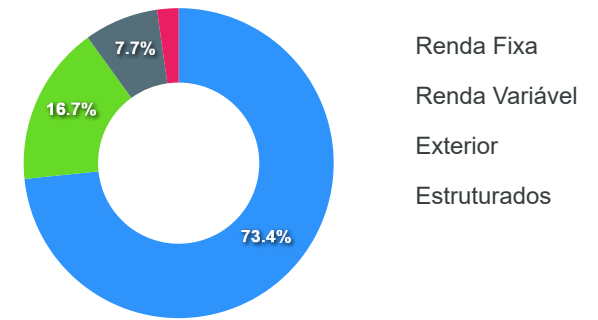
Governança (Pró Gestão)
 NIVEL 2 15/02/2025

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	11,30% 8.486.269,74	88,70% 66.607.498,06
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	32,97% 24.756.548,52	67,03% 50.337.219,28
7º III a - FI Referenciados RF	70,00%	29,06% 21.823.415,24	40,94% 30.742.222,22
8º I - Fundos de Ações	40,00%	16,64% 12.498.575,56	23,36% 17.538.931,56
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	7,73% 5.805.153,81	2,27% 1.704.222,97
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	2,23% 1.678.066,22	7,77% 5.831.310,56

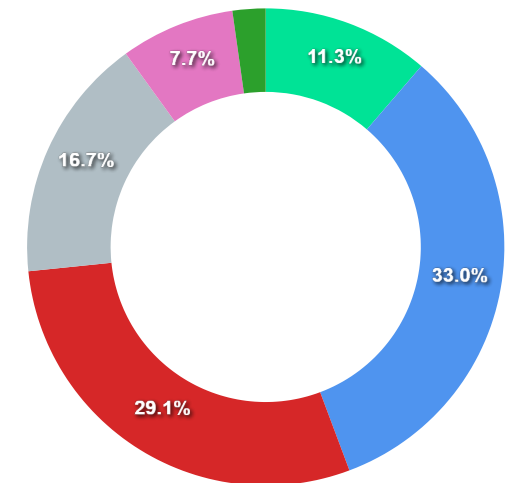
Governança (Pró Gestão)

🔗 NIVEL 2 15/02/2025

Segmentos



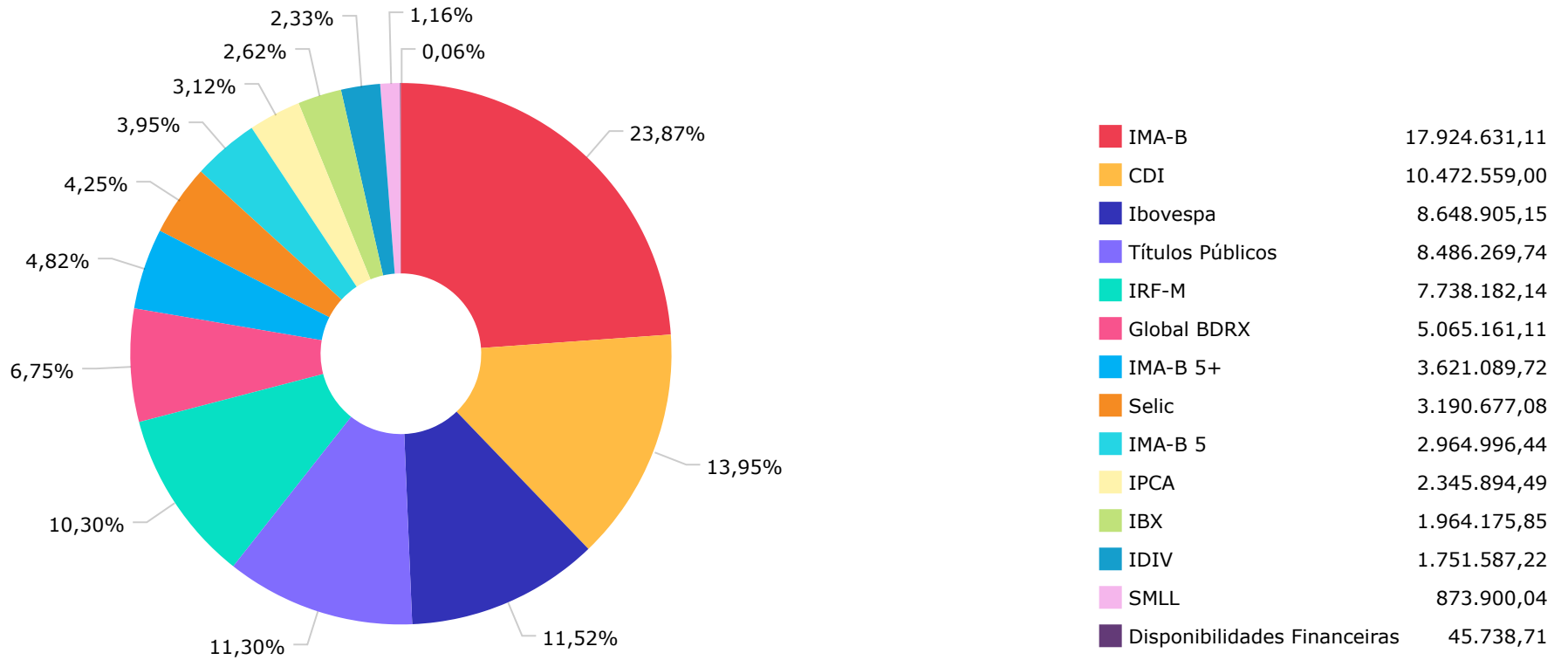
Artigos

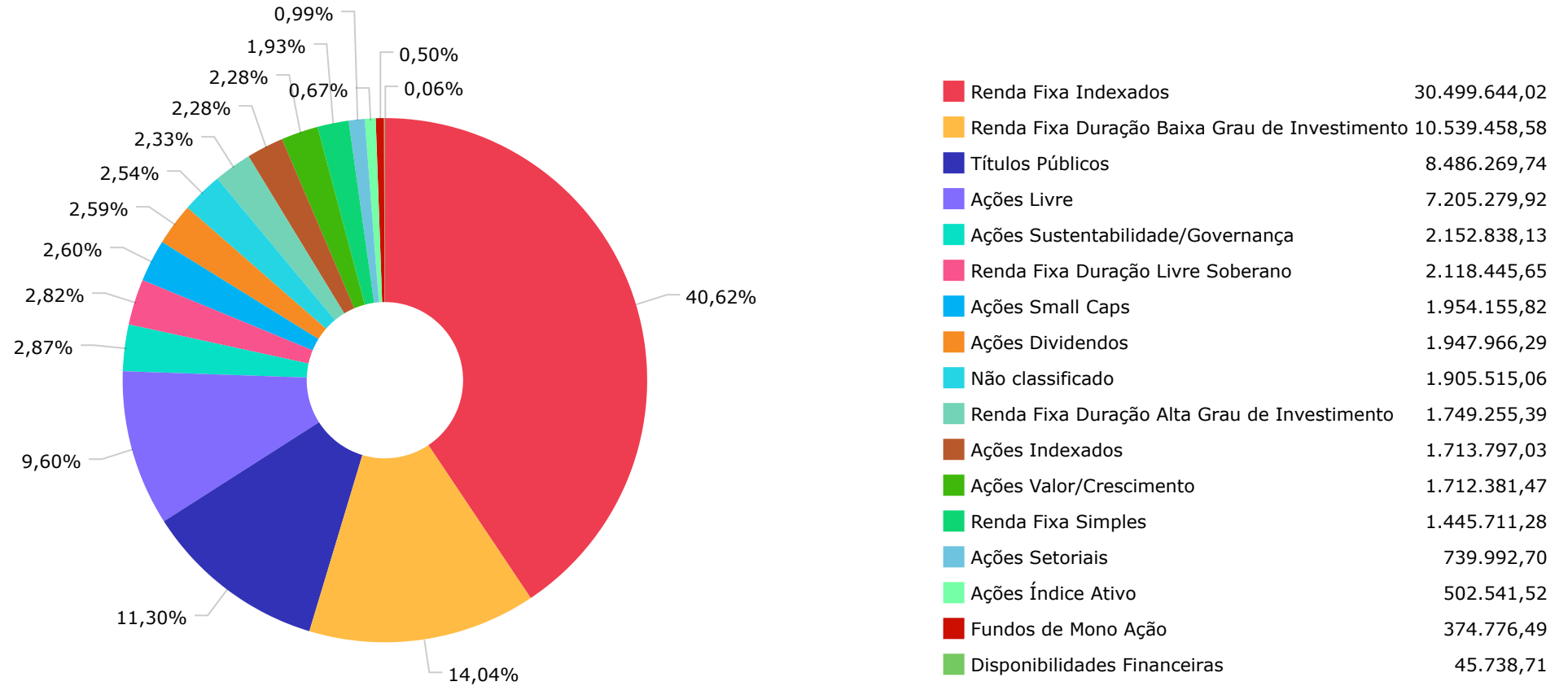


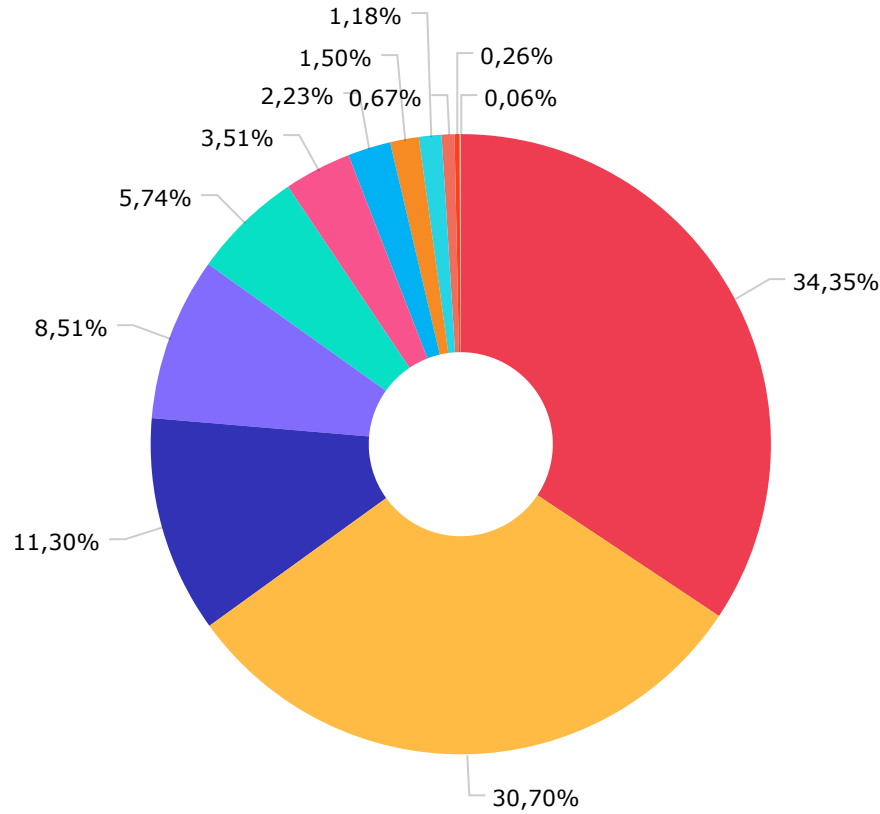
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	11,30%	0,00%	13,00%	100,00%	66.607.498,06	8° I - Fundos de Ações	16,64%	0,00%	28,00%	40,00%	17.538.931,56
7° I b - FI 100% Títulos TN	32,97%	0,00%	25,00%	100,00%	50.337.219,28	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	30.037.507,12
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	75.093.767,80	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.509.376,78
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.754.688,39	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.509.376,78
7° III a - FI Referenciados RF	29,06%	0,00%	20,00%	70,00%	30.742.222,22	9° III - Ações - BDR Nível I	7,73%	0,00%	8,00%	10,00%	1.704.222,97
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	70,00%	52.565.637,46	10° I - Fundos Multimercados	2,23%	0,00%	1,00%	10,00%	5.831.310,56
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	15.018.753,56	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.754.688,39
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	7.509.376,78	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.754.688,39
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	7.509.376,78	11° - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	7.509.376,78
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	7.509.376,78	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.509.376,78

	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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03	10,09	3,44	6,80	13,67	26,38	0,01	0,03
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97	9,87	3,22	6,49	13,40	26,08	0,01	0,02
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90	9,12	2,96	5,95	12,33	23,32	0,01	0,02
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	-3,73	20,68	-0,31	10,84			3,99	8,40
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
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,36	8,63	1,38	5,25	14,63	-9,67	5,58	11,76
IBOVESPA - BENCHMARK	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03		
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	8,81	56,42	16,39	66,68	48,70	170,16	13,76	28,98
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,35	29,82	1,07	16,55	16,22	-16,75	6,92	14,57
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	0,67	5,94	-1,29	14,07	5,77	4,94	7,41	15,60
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,58	3,98	-0,29	11,66	4,41	0,60	7,51	15,81
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	0,90	5,40	-1,05	14,24	4,22	1,06	7,77	16,37
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	0,07	5,49	-1,77	13,76	1,07	3,72	7,85	16,52
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,26	2,02	-1,96	10,30	-0,01	-4,02	7,72	16,25
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	-1,15	3,93	-0,82	13,52	-0,86	-5,22	9,17	19,31
IBX - BENCHMARK	0,84	5,50	-1,02	13,78	5,09	3,69		
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,06	5,86	-3,41	11,98	2,07	-11,33	9,04	19,05
BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-2,47	-6,15	-9,95	4,31	-11,45	-24,24	9,39	19,78
IDIV - BENCHMARK	1,32	10,67	1,25	15,38	14,16	22,39		
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,54	9,82	-0,27	14,91	9,96	14,99	6,43	13,54

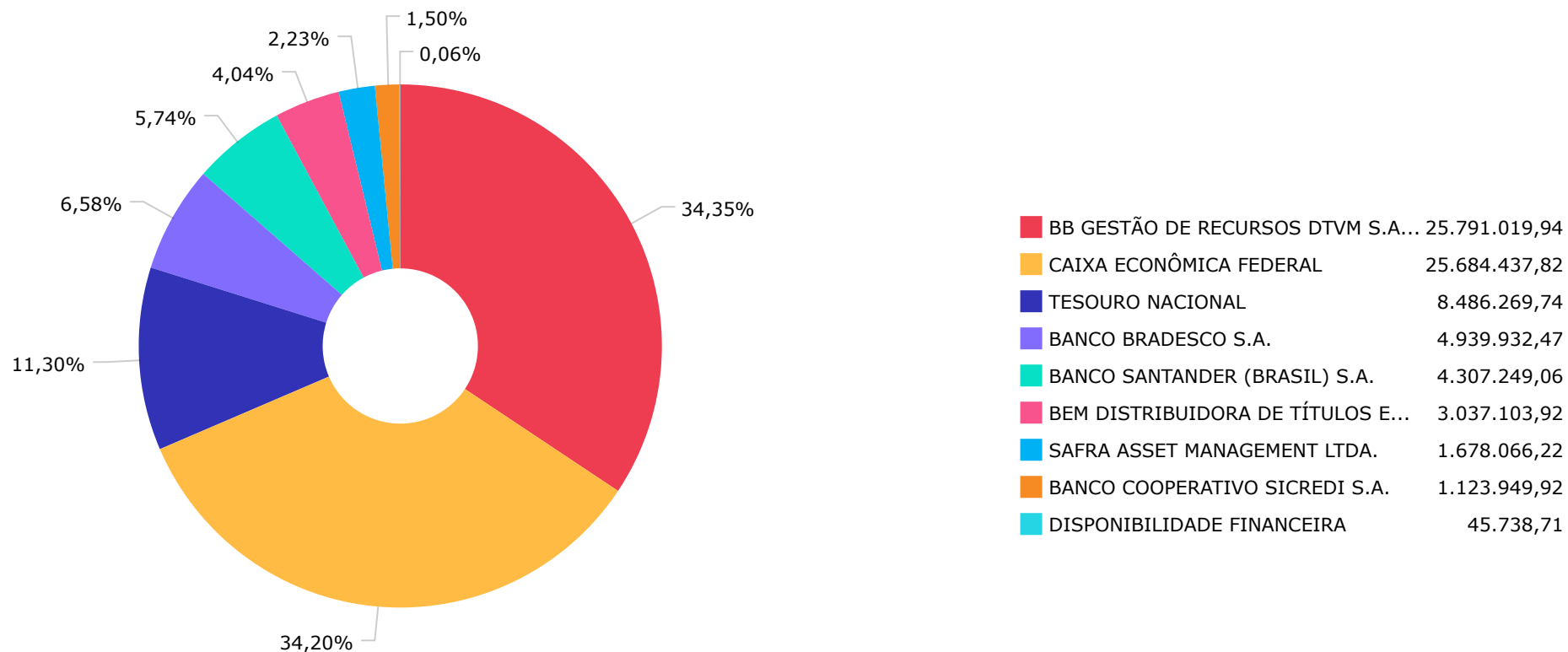
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,10	4,62	-2,05	12,35	4,98	12,91	7,42	15,62
IMA-B - BENCHMARK	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09		
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,96	10,58	-0,57	6,43	10,77	18,51	2,53	5,33
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA 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
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-1,04	10,57	-0,65	6,50	10,63	18,46	2,66	5,59
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
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,10	8,69	1,63	4,20	11,31	21,09	0,99	2,09
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88		
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,96	11,74	-2,55	7,96	9,74	15,04	4,04	8,50
IPCA - BENCHMARK	0,26	3,50	0,61	1,38	5,19	12,73		
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10	8,82	3,09	4,57	11,76		0,33	0,70
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09	8,79	3,08	4,56	11,73	22,62	0,33	0,70
IRF-M - BENCHMARK	0,17	11,62	1,83	7,45	13,57	22,67		
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15	11,49	1,77	7,33	13,46	22,40	1,12	2,35
SELIC - BENCHMARK	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80		
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05	10,30	3,54	6,88	13,98	27,19	0,03	0,07
SMLL - BENCHMARK	-2,84	5,06	-7,25	16,09	-2,94	-20,83		
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-3,69	6,32	-7,34	18,22	-3,12	-21,29	10,12	21,30







BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	25.791.019,94
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	23.050.659,34
TESOURO NACIONAL	8.486.269,74
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	6.394.195,73
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	4.307.249,06
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU...	2.633.778,48
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	1.678.066,22
CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ...	1.123.949,92
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	883.920,07
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	502.541,52
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECU...	196.379,07
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	45.738,71



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	66.807.439,99	9.800.000,00	10.326.378,39	67.338.346,55	1.057.284,95	1.057.284,95	1,58% ▲	1,58%	0,96%	0,96%	164,58%	3,61%
Fevereiro	67.338.346,55	655.445,37	828.391,20	66.815.101,27	-350.299,45	706.985,50	-0,52% ▼	1,05%	1,19%	2,17%	48,39%	2,99%
Março	66.815.101,27	735.961,32	78.270,62	68.153.138,56	680.346,59	1.387.332,09	1,01% ▲	2,07%	1,16%	3,36%	61,61%	2,61%
Abril	68.153.138,56	1.345.509,13	1.097.237,51	69.254.051,85	852.641,67	2.239.973,76	1,25% ▲	3,35%	0,96%	4,35%	77,01%	2,70%
Mai	69.254.051,85	7.390.922,40	7.020.863,55	71.400.402,21	1.776.291,51	4.016.265,27	2,55% ▲	5,98%	0,66%	5,04%	118,65%	2,62%
Junho	71.400.402,21	7.430.102,45	7.127.162,62	73.740.934,57	2.037.592,53	6.053.857,80	2,84% ▲	8,99%	0,33%	5,39%	166,79%	2,86%
Julho	73.740.934,57	697.011,28	407.266,71	75.114.247,65	1.083.568,51	7.137.426,31	1,46% ▲	10,59%	0,53%	5,95%	177,98%	2,56%
Agosto	75.114.247,65	718.122,73	222.313,52	74.997.706,83	-612.350,03	6.525.076,28	-0,81% ▼	9,69%	0,68%	6,67%	145,28%	2,63%
Setembro	74.997.706,83	690.640,18	327.916,50	75.048.029,09	-312.401,42	6.212.674,86	-0,41% ▼	9,24%	0,65%	7,37%	125,37%	2,84%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	1.387.332,09	2,07%	3,36%
2º Trim	4.666.525,71	6,78%	1,97%
1º Sem	6.053.857,80	8,99%	5,39%
3º Trim	158.817,06	0,22%	1,88%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado



Gráfico Risco x Retorno

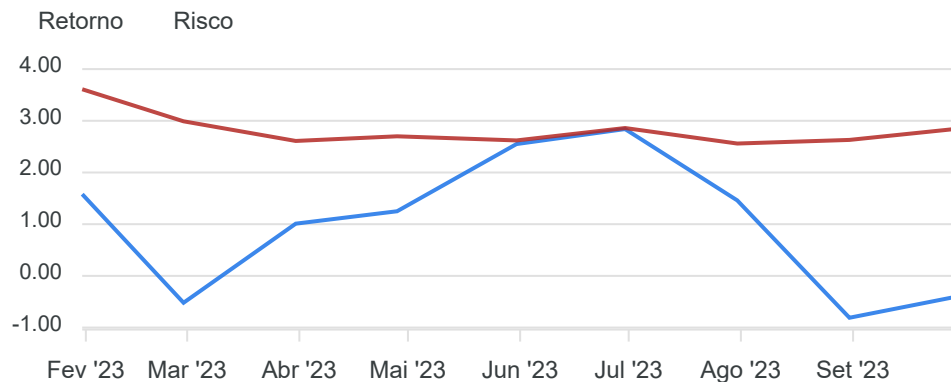
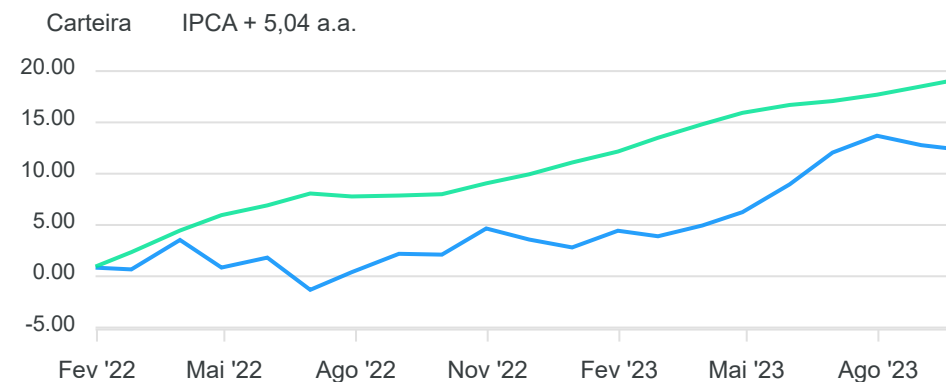
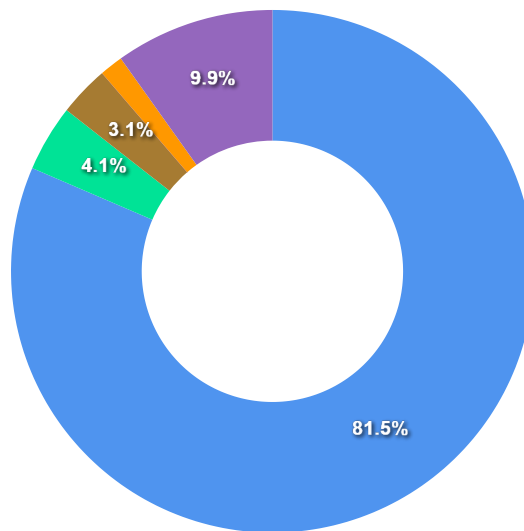


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 29/09/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	61.171.642,36	81,51
Até D+180	3.089.961,21	4,12
Até D+360	2.345.894,49	3,13
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	1.088.621,24	1,45
Acima D+3600	7.397.648,50	9,86
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	8.428.579,75	0,00	0,00	8.486.269,74	57.689,99	0,68% ▲	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.040.146,04	690.640,18	297.916,50	1.445.711,28	12.841,56	0,74% ▲	0,01%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.693.315,55	0,00	0,00	3.621.089,72	-72.225,83	-1,96% ▼	4,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.864.700,73	0,00	0,00	7.788.499,83	-76.200,90	-0,97% ▼	2,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.146.627,80	0,00	0,00	4.186.849,35	40.221,55	0,97% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	224.986,01	0,00	0,00	227.448,84	2.462,83	1,09% ▲	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.095.430,87	0,00	0,00	2.118.445,65	23.014,78	1,10% ▲	0,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1.747.500,14	0,00	0,00	1.749.255,39	1.755,25	0,10% ▲	0,99%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.157.541,95	0,00	0,00	3.190.677,08	33.135,13	1,05% ▲	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.263.632,60	0,00	0,00	1.276.600,87	12.968,27	1,03% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.214.382,01	0,00	0,00	1.215.741,05	1.359,04	0,11% ▲	0,98%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.726.898,59	0,00	0,00	7.738.182,14	11.283,55	0,15% ▲	1,12%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	7.035.038,84	0,00	0,00	6.965.040,07	-69.998,77	-1,00% ▼	2,59%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2.067.064,79	0,00	0,00	2.047.141,29	-19.923,50	-0,96% ▼	2,53%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.896.279,59	0,00	30.000,00	1.885.331,28	19.051,69	1,00% ▲	0,01%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.135.810,72	0,00	0,00	1.123.949,92	-11.860,80	-1,04% ▼	2,66%
	54.737.935,98	690.640,18	327.916,50	55.066.233,50	-34.426,16	-0,06%	1,33%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	893.349,95	0,00	0,00	883.920,07	-9.429,88	-1,06% ▼	9,04%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.707.956,60	0,00	0,00	1.712.381,47	4.424,87	0,26% ▲	7,72%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.133.588,91	0,00	0,00	2.152.838,13	19.249,22	0,90% ▲	7,77%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	907.378,37	0,00	0,00	873.900,04	-33.478,33	-3,69% ▼	10,12%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	374.385,08	0,00	0,00	374.007,48	-377,60	-0,10% ▼	7,42%
BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.107.644,78	0,00	0,00	1.080.255,78	-27.389,00	-2,47% ▼	9,39%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVSPA FI AÇÕES	1.702.391,85	0,00	0,00	1.713.797,03	11.405,18	0,67% ▲	7,41%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.370.193,77	0,00	0,00	1.377.579,74	7.385,97	0,54% ▲	6,43%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.255.261,23	0,00	0,00	1.256.198,74	937,51	0,07% ▲	7,85%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	195.237,50	0,00	0,00	196.379,07	1.141,57	0,58% ▲	7,51%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	508.400,60	0,00	0,00	502.541,52	-5.859,08	-1,15% ▼	9,17%
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	344.420,91	0,00	0,00	374.776,49	30.355,58	8,81% ▲	13,76%
-	12.500.209,55	0,00	0,00	12.498.575,56	-1.633,99	-0,01%	8,19%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1.743.064,19	0,00	0,00	1.678.066,22	-64.997,97	-3,73% ▼	3,99%
-	1.743.064,19	0,00	0,00	1.678.066,22	-64.997,97	-3,73%	3,99%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	956.012,10	0,00	0,00	923.862,93	-32.149,17	-3,36% ▼	5,58%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	765.651,45	0,00	0,00	739.992,70	-25.658,75	-3,35% ▼	6,92%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.294.833,56	0,00	0,00	4.141.298,18	-153.535,38	-3,57% ▼	4,97%
	6.016.497,11	0,00	0,00	5.805.153,81	-211.343,30	-3,51%	1,77%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	125.322,44	2.105.774,19	812.241,74	1.445.711,28	26.856,39	1,20% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.715.879,43	0,00	0,00	3.621.089,72	-94.789,71	-2,55% ▼
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.838.902,98	0,00	0,00	7.788.499,83	-50.403,15	-0,64% ▼
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.056.099,26	0,00	0,00	4.186.849,35	130.750,09	3,22% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	227.175,61	0,00	6.630,37	227.448,84	6.903,60	3,04% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.112.618,20	0,00	58.624,62	2.118.445,65	64.452,07	3,05% ▲
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1.721.131,39	0,00	0,00	1.749.255,39	28.124,00	1,63% ▲
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.081.572,57	0,00	0,00	3.190.677,08	109.104,51	3,54% ▲
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.234.107,04	0,00	0,00	1.276.600,87	42.493,83	3,44% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.195.795,01	0,00	0,00	1.215.741,05	19.946,04	1,67% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.603.649,78	0,00	0,00	7.738.182,14	134.532,36	1,77% ▲
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	7.001.724,03	0,00	0,00	6.965.040,07	-36.683,96	-0,52% ▼
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2.058.966,66	0,00	0,00	2.047.141,29	-11.825,37	-0,57% ▼
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.900.041,81	0,00	80.000,00	1.885.331,28	65.289,47	3,44% ▲
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.131.317,92	0,00	0,00	1.123.949,92	-7.368,00	-0,65% ▼
TÍTULOS PÚBLICOS	8.538.871,02	0,00	0,00	8.486.269,74	-52.601,28	-0,62% ▼
	53.543.175,15	2.105.774,19	957.496,73	55.066.233,50	374.780,89	0,69%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	915.094,03	0,00	0,00	883.920,07	-31.173,96	-3,41% ▼
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.746.595,89	0,00	0,00	1.712.381,47	-34.214,42	-1,96% ▼
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.175.633,42	0,00	0,00	2.152.838,13	-22.795,29	-1,05% ▼
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	943.173,24	0,00	0,00	873.900,04	-69.273,20	-7,34% ▼
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	381.843,55	0,00	0,00	374.007,48	-7.836,07	-2,05% ▼
BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.199.610,45	0,00	0,00	1.080.255,78	-119.354,67	-9,95% ▼
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.736.170,21	0,00	0,00	1.713.797,03	-22.373,18	-1,29% ▼
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.381.240,82	0,00	0,00	1.377.579,74	-3.661,08	-0,27% ▼
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.278.890,78	0,00	0,00	1.256.198,74	-22.692,04	-1,77% ▼
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	196.951,92	0,00	0,00	196.379,07	-572,85	-0,29% ▼
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	506.681,75	0,00	0,00	502.541,52	-4.140,23	-0,82% ▼
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	321.990,14	0,00	0,00	374.776,49	52.786,35	16,39% ▲
	12.783.876,20	0,00	0,00	12.498.575,56	-285.300,64	-2,23%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1.683.254,90	0,00	0,00	1.678.066,22	-5.188,68	-0,31% ▼
	1.683.254,90	0,00	0,00	1.678.066,22	-5.188,68	-0,31%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	911.305,17	0,00	0,00	923.862,93	12.557,76	1,38% ▲
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	732.155,44	0,00	0,00	739.992,70	7.837,26	1,07% ▲
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.087.167,71	0,00	0,00	4.141.298,18	54.130,47	1,32% ▲
	5.730.628,32	0,00	0,00	5.805.153,81	74.525,49	1,30%

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

Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **IMPREV INST MUNC PREV VIRADOURO - SP** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Setembro/2023**, atestando os dados relativos à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

Aprovação do Conselho Fiscal

O Conselho Fiscal do **IMPREV INST MUNC PREV VIRADOURO - SP** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Setembro/2023** bem como o parecer do Comitê de Investimentos, que tratam do acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do **IMPREV INST MUNC PREV VIRADOURO - SP** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

