

2023

Relatório Mensal

Outubro

Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.596.518,76	3,53%	6.082.622.569,66	0,14%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.579.073,05	1,47%	5.824.441.376,72	0,06%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.267.421,21	1,34%	5.252.934.178,04	0,06%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.070.348,83	4,14%	990.612.617,19	1,02%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.850.274,19	4,05%	909.559.521,82	1,08%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.137.934,89	2,11%	3.536.045.684,72	0,15%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.156.792,86	4,17%	1.801.029.516,58	0,56%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	120.023,73	0,05%	5.136.324.306,86	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	16.100.603,93	6,62%	206.429.417,85	7,80%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.411.024,08	3,05%	7.787.487.970,57	0,10%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.956.746,15	5,33%	5.036.600.197,80	0,26%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.537.602,40	6,80%	7.795.296.699,71	0,21%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	672.837,28	0,28%	12.230.065.528,97	0,01%	7º I b
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	8.242.619,55	3,39%	145.415.638,55	5,67%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	24.652.646,18	10,13%	1.446.236.926,00	1,70%	7º I b
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	23.678.311,35	9,73%	1.956.756.289,21	1,21%	7º I b
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	9.922.286,37	4,08%	1.199.029.057,59	0,83%	7º I b
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	10.217.028,08	4,20%	6.569.325.723,06	0,16%	7º III a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.617.678,98	0,66%	3.689.670.141,46	0,04%	7º III a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.783.698,61	4,43%	14.076.402.461,33	0,08%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	4.006.705,51	1,65%	723.610.534,87	0,55%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	8.443.995,29	3,47%	560.834.418,92	1,51%	7º III a
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.932.946,42	1,62%	763.608.202,26	0,52%	8º I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.101.230,07	0,86%	1.302.352.358,50	0,16%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.727.636,81	0,71%	586.219.451,06	0,29%	8º I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.887.127,53	2,42%	684.321.543,81	0,86%	8º I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.833.648,83	1,16%	610.653.217,70	0,46%	8º I

Investimentos

\$ 243.316.253,17

Disponibilidades Financeiras

\$ 59.799,22

Total Carteira

\$ 243.376.052,39

Governança (Pró Gestão)

[☰](#)

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.958.373,40	2,04%	235.146.383,33	2,11%	8º I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.108.298,67	1,28%	607.119.682,04	0,51%	9º III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I I	2.692.113,78	1,11%	152.169.926,91	1,77%	9º III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	972.225,73	0,40%	1.436.932.092,12	0,07%	10º I
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.666.408,69	0,68%	1.378.652.401,38	0,12%	10º I
CAIXA AUTOMÁTICO POLIS FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	7.414.071,96	3,05%	11.422.097.218,57	0,06%	NE

Investimentos

\$ 243.316.253,17

Disponibilidades Financeiras

\$ 59.799,22

Total Carteira

\$ 243.376.052,39

Governança (Pró Gestão)

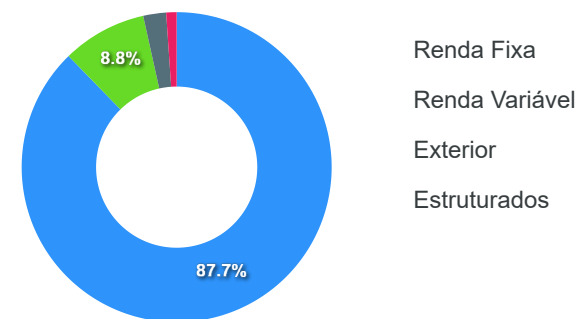


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	70,24%	170.953.064,81 29,76%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	14,41%	35.069.106,47 45,59%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	8,81%	21.440.963,06 21,19%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	2,38%	5.800.412,45 7,62%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	1,08%	2.638.634,42 8,92%
Não Enquadrado	0,00%	3,05%	7.414.071,96 -3,05%

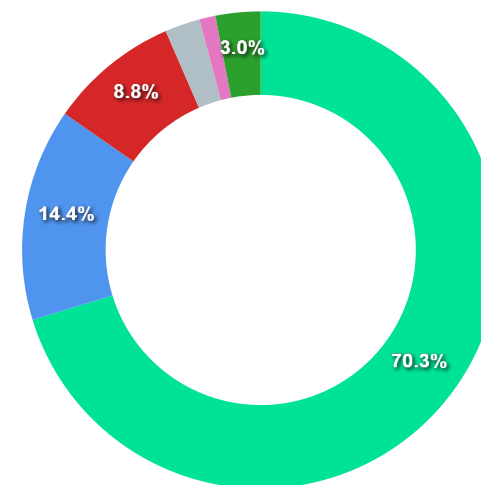
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos

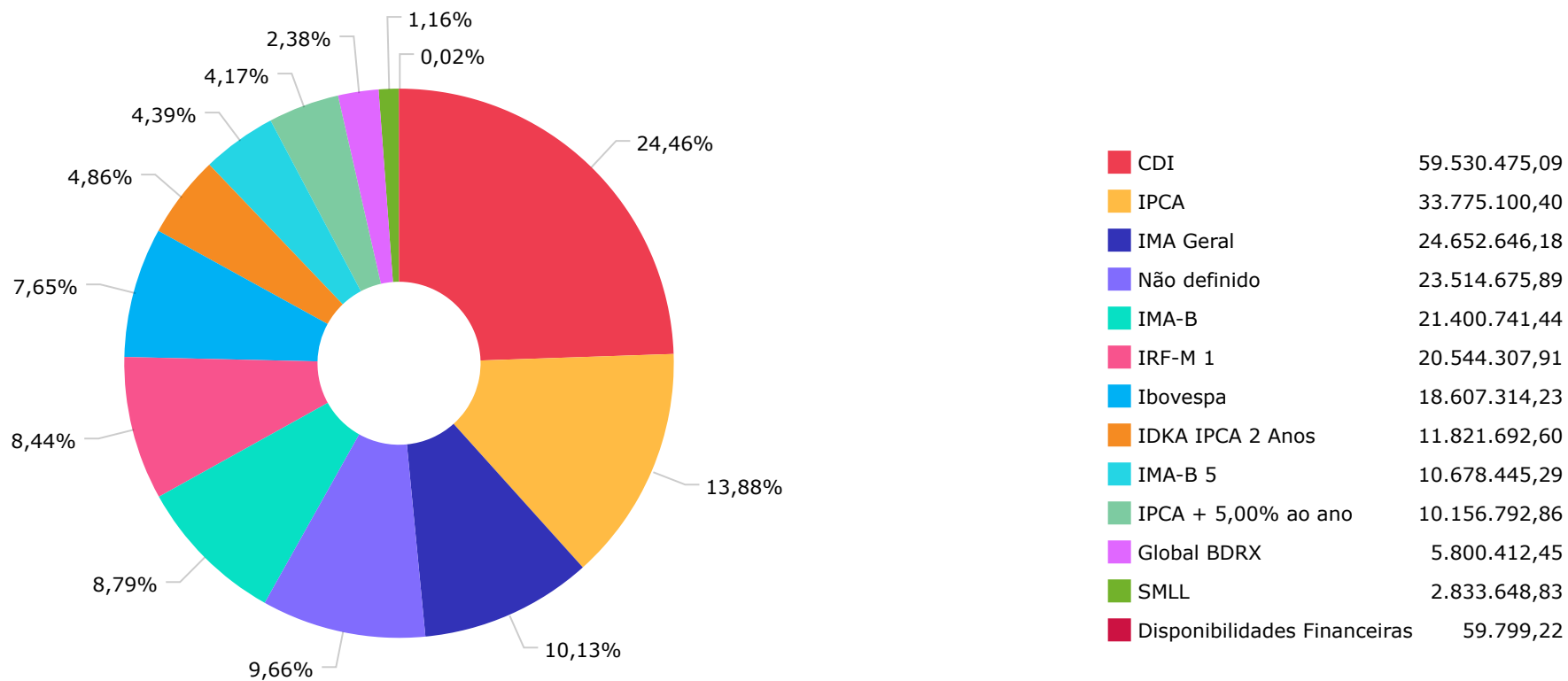


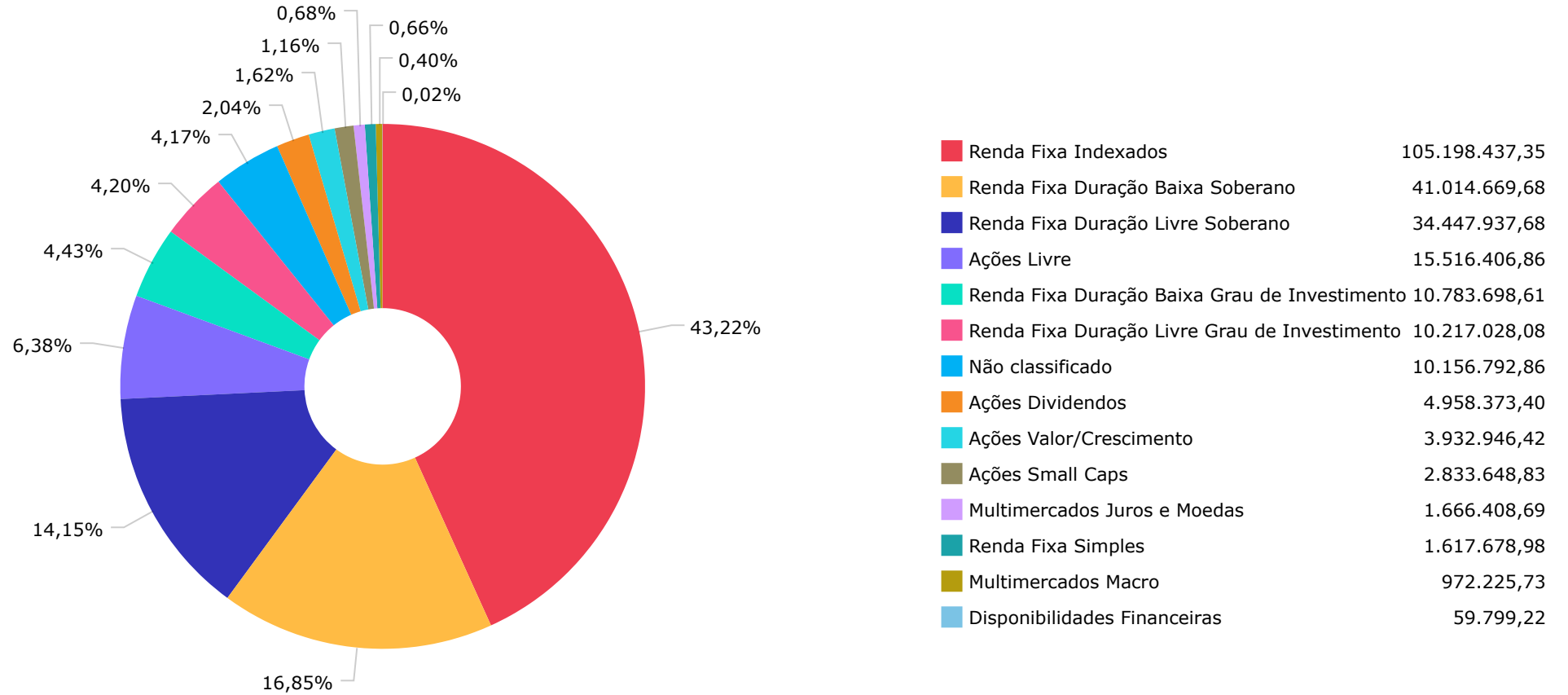
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	243.376.052,39	8° I - Fundos de Ações	8,81%	0,00%	18,00%	30,00%	51.571.852,66
7° I b - FI 100% Títulos TN	70,24%	0,00%	50,00%	100,00%	72.422.987,58	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	73.012.815,72
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	243.376.052,39	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	24.337.605,24
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.168.802,62	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	24.337.605,24
7° III a - FI Referenciados RF	14,41%	0,00%	15,00%	60,00%	110.956.524,96	9° III - Ações - BDR Nível I	2,38%	0,00%	5,00%	10,00%	18.537.192,79
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	146.025.631,43	10° I - Fundos Multimercados	1,08%	0,00%	6,00%	10,00%	21.698.970,82
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	48.675.210,48	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.168.802,62
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.168.802,62	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.168.802,62
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.168.802,62	11° - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.168.802,62
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.168.802,62	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.168.802,62
Não Enquadrado	3,05%	0,00%	0,00%	0,00%	-7.414.071,96						

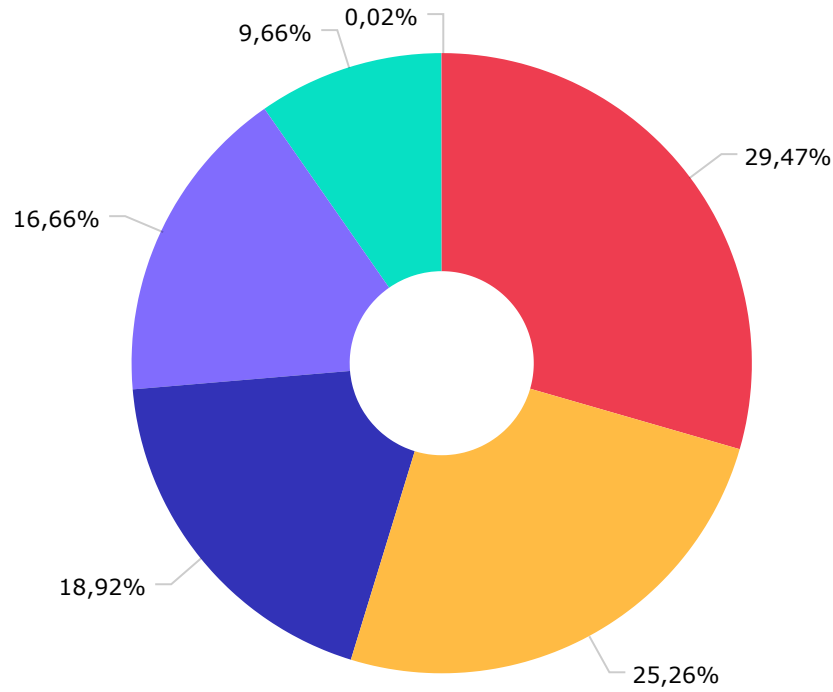
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	0,00	11,72	0,87	6,44	12,28		2,21	4,65
CAIXA AUTOMÁTICO POLIS FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,71		2,25				0,00	0,00
CDI - BENCHMARK								
	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45		
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,39	11,86	5,70	8,07	14,03		1,88	3,96
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,02	11,21	3,32	6,91	13,65	27,03	0,02	0,03
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,96	11,01	3,15	6,60	13,36	26,37	0,02	0,04
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,96	10,95	3,13	6,57	13,29	26,21	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 JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,85	10,45	2,63	6,34	12,57	26,96	0,14	0,30
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90	10,10	2,88	6,02	12,28	23,94	0,01	0,02
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		
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,66	6,83	-2,37	4,15	8,05	-19,65	7,88	16,59
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I I	-1,23	2,27	0,53	3,04	2,76	-13,13	6,93	14,60
IBOVESPA - BENCHMARK								
	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32		
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,83	5,60	-6,56	9,05	1,98	17,18	6,91	14,55
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-5,73	5,39	-9,05	8,04	-1,21	13,64	9,24	19,46
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,90	1,40	-6,64	8,29	-5,16	2,67	6,99	14,72
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,79	-1,85	-9,15	4,80	-7,15	-2,25	7,84	16,51
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-5,29	0,47	-9,76	7,47	-10,82	-1,56	8,34	17,56
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK								
	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65		
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	-0,34	8,37	0,67	3,05	8,90	21,79	1,33	2,81

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,33	8,23	0,62	3,00	8,84	22,05	1,32	2,78
IMA GERAL - BENCHMARK	0,30	10,92	1,11	5,71	11,71	24,89		
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	-0,32	8,39	0,39	2,97	9,01	22,68	1,43	3,01
IMA-B - BENCHMARK	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40		
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
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,72	9,77	-2,16	3,63	8,60	20,73	3,13	6,60
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
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,32	8,40	0,37	2,99	8,99	22,58	1,43	3,01
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
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44	9,29	2,46	4,49	10,17		0,48	1,00
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,84	9,95	-2,33	3,37	8,95		3,18	6,69
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		
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,93	11,21	3,07	6,74	13,55	26,84	0,15	0,33
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
SMLL - BENCHMARK	-7,40	-2,72	-16,71	5,49	-16,24	-16,19		
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-7,45	-2,95	-16,62	4,98	-16,39	-17,11	12,17	25,63

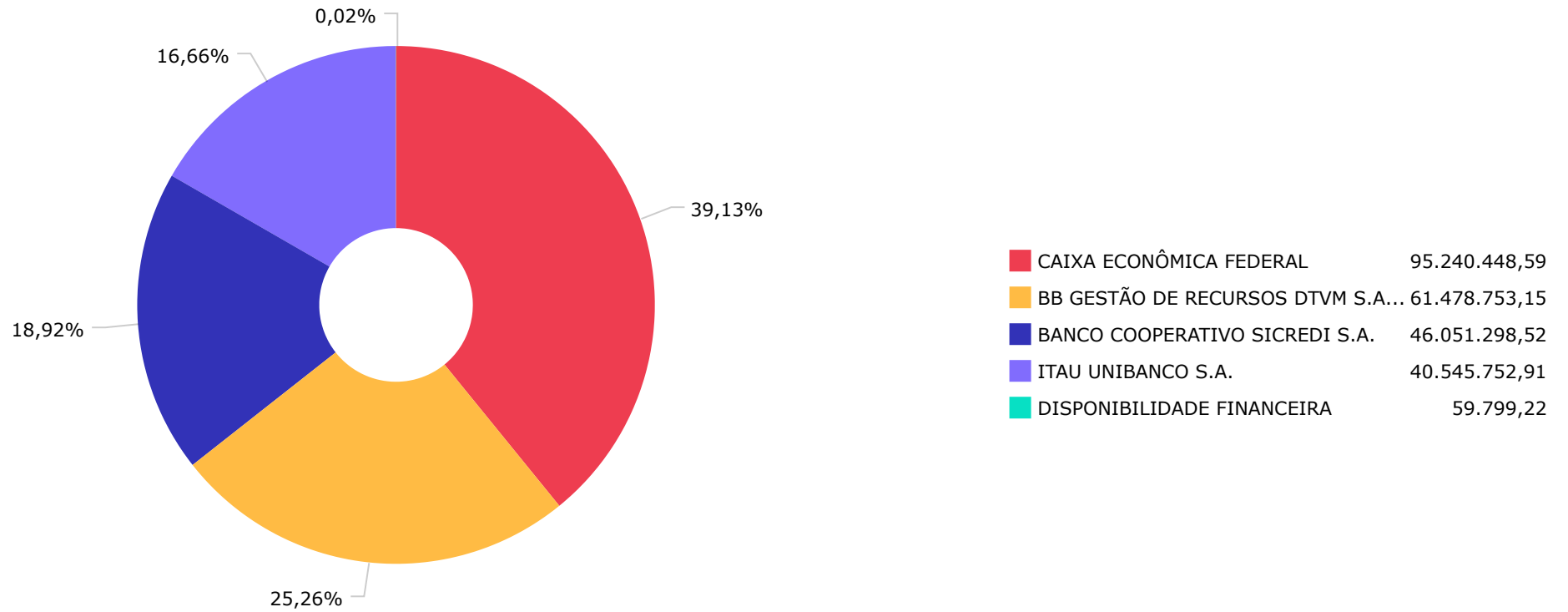
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IPCA + 5,00% AO ANO - BENCHMARK	0,65	8,03	1,97	3,50	10,06	23,04		
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,44		-0,41				0,48	1,00







CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	71.725.772,70
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	61.478.753,15
CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ...	46.051.298,52
ITAU UNIBANCO S.A.	40.545.752,91
CAIXA DTVM	23.514.675,89
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	59.799,22



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	194.493.897,18	6.526.175,51	1.316.281,01	202.893.526,39	3.189.734,71	3.189.734,71	1,60% ▲	1,60%	0,97%	0,97%	164,95%	2,49%
Fevereiro	202.893.526,39	8.576.926,20	6.147.096,36	205.109.408,78	-213.947,45	2.975.787,26	-0,10% ▼	1,49%	1,20%	2,18%	68,35%	2,11%
Março	205.109.408,78	3.482.334,83	1.084.949,46	209.409.490,73	1.902.696,58	4.878.483,84	0,92% ▲	2,42%	1,17%	3,37%	71,81%	2,01%
Abril	209.409.490,73	6.004.707,70	2.969.086,95	214.738.437,63	2.293.326,15	7.171.809,99	1,08% ▲	3,53%	0,97%	4,38%	80,59%	1,85%
Mai	214.738.437,63	31.773.719,25	28.996.047,15	220.730.939,36	3.214.829,63	10.386.639,62	1,48% ▲	5,06%	0,67%	5,07%	99,80%	1,84%
Junho	220.730.939,36	21.682.448,10	18.918.853,99	228.458.628,56	4.964.095,09	15.350.734,71	2,22% ▲	7,39%	0,34%	5,42%	136,35%	1,81%
Julho	228.458.628,56	5.665.650,55	3.271.338,72	233.635.174,93	2.782.234,54	18.132.969,25	1,21% ▲	8,69%	0,54%	5,99%	145,08%	1,57%
Agosto	233.635.174,93	3.666.713,71	1.015.847,97	236.502.912,23	216.871,56	18.349.840,81	0,09% ▲	8,79%	0,69%	6,72%	130,80%	1,78%
Setembro	236.502.912,23	7.406.755,20	5.086.755,21	239.632.030,40	809.118,18	19.158.958,99	0,34% ▲	9,15%	0,66%	7,42%	123,32%	1,72%
Outubro	239.632.030,40	22.778.229,53	18.400.000,00	243.316.253,17	-694.006,76	18.464.952,23	-0,28% ▼	8,84%	0,66%	8,13%	108,73%	1,98%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	4.878.483,84	2,42%	3,37%
2º Trim	10.472.250,87	4,85%	1,98%
1º Sem	15.350.734,71	7,39%	5,42%
3º Trim	3.808.224,28	1,64%	1,89%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

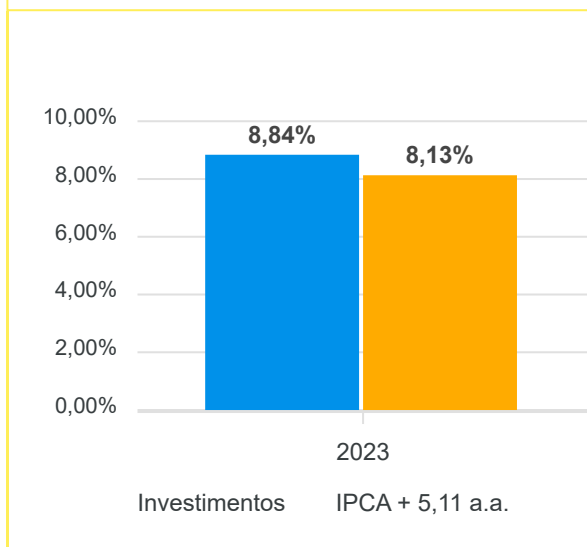


Gráfico Risco x Retorno

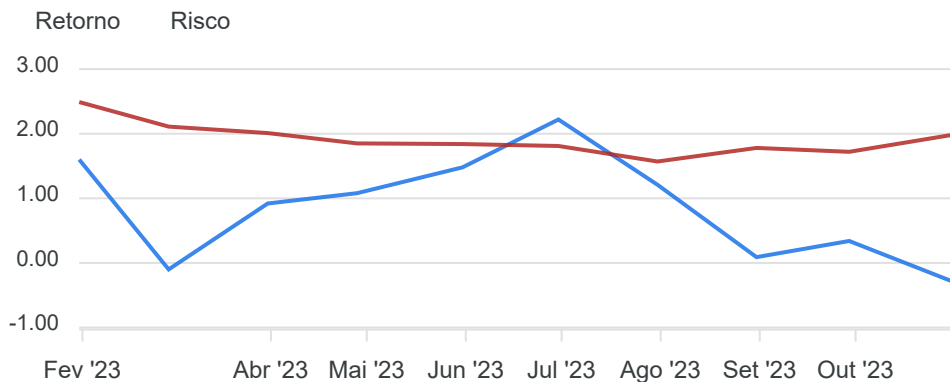
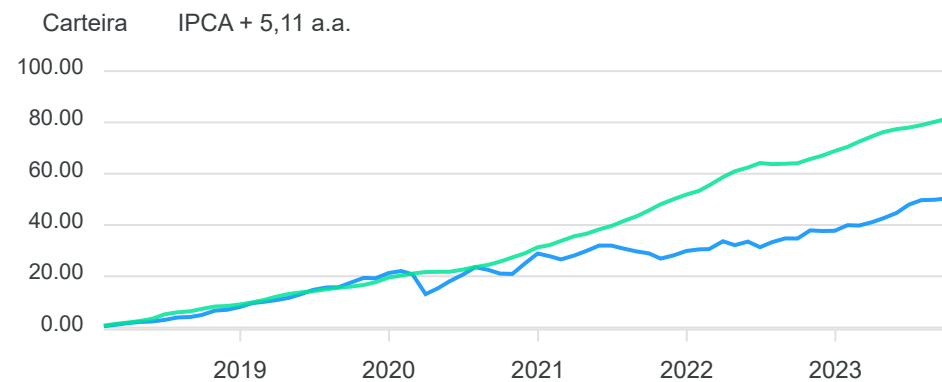
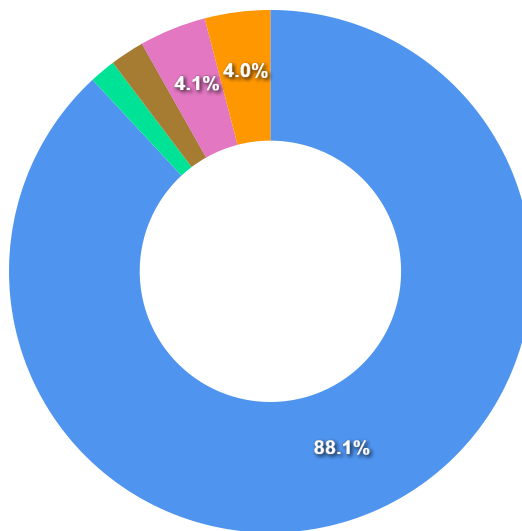


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/10/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	214.384.548,06	88,11
Até D+180	3.932.946,42	1,62
Até D+360	5.137.934,89	2,11
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	10.070.348,83	4,14
Até D+3600	9.850.274,19	4,05
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	0,00	0,00



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.523.994,85	0,00	0,00	8.596.518,76	72.523,91	0,85% ▲	0,26%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	19.959.240,08	0,00	10.000.000,00	10.217.028,08	257.788,00	1,29% ▲	1,88%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.105.059,41	1.500.169,07	1.000.000,00	1.617.678,98	12.450,50	0,48% ▲	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.590.913,69	0,00	0,00	3.579.073,05	-11.840,64	-0,33% ▼	1,32%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.278.041,54	0,00	0,00	3.267.421,21	-10.620,33	-0,32% ▼	1,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.176.307,54	0,00	0,00	10.070.348,83	-105.958,71	-1,04% ▼	2,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.934.006,35	0,00	0,00	9.850.274,19	-83.732,16	-0,84% ▼	3,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.115.630,54	0,00	0,00	5.137.934,89	22.304,35	0,44% ▲	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.111.841,61	0,00	0,00	10.156.792,86	44.951,25	0,44% ▲	0,48%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.183.671,09	850.000,00	4.400.000,00	10.783.698,61	150.027,52	1,00% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	119.716,48	0,00	0,00	120.023,73	307,25	0,26% ▲	0,90%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	16.101.243,77	0,00	0,00	16.100.603,93	-639,84	0,00% ▼	2,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.444.624,37	0,00	3.000.000,00	7.411.024,08	-33.600,29	-0,32% ▼	1,43%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.043.414,95	0,00	0,00	12.956.746,15	-86.668,80	-0,66% ▼	3,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.387.974,23	3.014.000,00	0,00	16.537.602,40	135.628,17	0,83% ▲	0,12%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	666.468,29	0,00	0,00	672.837,28	6.368,99	0,96% ▲	0,02%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	8.270.851,82	0,00	0,00	8.242.619,55	-28.232,27	-0,34% ▼	1,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	24.732.980,00	0,00	0,00	24.652.646,18	-80.333,82	-0,32% ▼	1,43%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	8.505.264,52	0,00	0,00	8.443.995,29	-61.269,23	-0,72% ▼	3,13%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	17.498.730,11	6.000.000,00	0,00	23.678.311,35	179.581,24	0,76% ▲	0,02%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	9.828.297,29	0,00	0,00	9.922.286,37	93.989,08	0,96% ▲	0,02%
CAIXA AUTOMÁTICO POLIS FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	7.414.071,96	0,00	7.414.071,96	0,00	0,00%	0,00%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,00	3.999.988,50	0,00	4.006.705,51	6.717,01	0,17% ▲	0,15%
	208.578.272,53	22.778.229,53	18.400.000,00	213.436.243,24	479.741,18	0,23%	1,19%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.088.032,34	0,00	0,00	3.932.946,42	-155.085,92	-3,79% ▼	7,84%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.164.046,51	0,00	0,00	2.101.230,07	-62.816,44	-2,90% ▼	6,99%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.824.073,61	0,00	0,00	1.727.636,81	-96.436,80	-5,29% ▼	8,34%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6.245.273,35	0,00	0,00	5.887.127,53	-358.145,82	-5,73% ▼	9,24%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	3.061.666,63	0,00	0,00	2.833.648,83	-228.017,80	-7,45% ▼	12,17%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.155.824,93	0,00	0,00	4.958.373,40	-197.451,53	-3,83% ▼	6,91%
-	22.538.917,37	0,00	0,00	21.440.963,06	-1.097.954,31	-4,87%	8,54%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	976.198,34	0,00	0,00	972.225,73	-3.972,61	-0,41% ▼	2,40%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.652.320,46	0,00	0,00	1.666.408,69	14.088,23	0,85% ▲	0,14%
-	2.628.518,80	0,00	0,00	2.638.634,42	10.115,62	0,38%	0,97%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.160.754,58	0,00	0,00	3.108.298,67	-52.455,91	-1,66% ▼	7,88%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I I	2.725.567,12	0,00	0,00	2.692.113,78	-33.453,34	-1,23% ▼	6,93%
	5.886.321,70	0,00	0,00	5.800.412,45	-85.909,25	-1,46%	4,22%

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

