

2023

Relatório Mensal

Agosto

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	206.079.840,20	30,52%	0,00		7º I a
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.012.885,05	0,59%	5.967.981.074,09	0,07%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.221.506,96	1,22%	6.160.923.946,07	0,13%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.506.367,61	0,82%	1.858.783.140,34	0,30%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.995.415,89	1,78%	2.413.618.165,51	0,50%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.319.867,86	0,64%	208.416.569,80	2,07%	7º I b
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.751.023,08	0,41%	20.185.349,10	13,63%	7º I b
BTG PACTUAL TESOURO CURTO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA	27.920.051,38	4,13%	822.425.129,89	3,39%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.585.155,02	1,12%	3.750.386.694,20	0,20%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.502.529,60	0,96%	229.478.681,29	2,83%	7º I b
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.139.460,87	1,95%	235.929.641,69	5,57%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.498.130,28	0,67%	5.279.029.725,18	0,09%	7º I b
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.227.846,14	1,22%	5.478.324.181,39	0,15%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5+ PREMIUM FIC RENDA FIXA	2.980.848,17	0,44%	341.054.251,42	0,87%	7º I b
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.047.025,64	3,27%	908.646.715,44	2,43%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	7.284.003,30	1,08%	3.554.344.878,79	0,20%	7º III a
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.873.085,20	3,39%	953.178.073,80	2,40%	7º III a
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.249.243,75	1,07%	9.013.672.474,30	0,08%	7º III a
LETRA FINANCEIRA BTG	25.178.948,46	3,73%	0,00		7º IV
LF BTG 18/05/2026 IPCA + 6,10%	15.330.448,50	2,27%	0,00		7º IV
LF BTG 26/05/2025 IPCA + 6,93%	5.927.360,49	0,88%	0,00		7º IV
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	17.131,43	0,00%	19.400.107,45	0,09%	7º V a
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	578,11	0,00%	425.043,24	0,14%	7º V a
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	50.020,39	0,01%	0,00		7º V a
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	595.548,90	0,09%	31.424.912,92	1,90%	7º V a
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	11.376.987,70	1,68%	315.349.024,58	3,61%	7º V b
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.069.852,85	0,75%	2.094.567.917,17	0,24%	7º V b

Investimentos

\$ 675.215.595,23

Disponibilidades Financeiras

\$ 194.869,50

Total Carteira

\$ 675.410.464,73

Governança (Pró Gestão)



Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	6.406.175,29	0,95%	206.627.979,19	3,10%	7º V b
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1.941.445,23	0,29%	1.184.643.070,21	0,16%	8º I
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.990.442,38	1,63%	465.488.479,68	2,36%	8º I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	12.078.060,86	1,79%	269.065.134,22	4,49%	8º I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	23.161.504,69	3,43%	1.275.799.220,44	1,82%	8º I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.594.999,87	1,42%	462.938.656,65	2,07%	8º I
BB AGRO FIC AÇÕES	10.852.163,57	1,61%	370.781.948,14	2,93%	8º I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.127.978,73	1,20%	1.370.383.182,87	0,59%	8º I
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	5.212.587,27	0,77%	766.784.766,92	0,68%	8º I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	21.343.210,36	3,16%	646.477.640,57	3,30%	8º I
OCCAM FIC AÇÕES	18.959.479,59	2,81%	858.457.646,61	2,21%	8º I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.273.449,09	0,48%	148.607.541,02	2,20%	8º I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	9.383.357,32	1,39%	129.178.181,69	7,26%	8º I
SPX APACHE FIC AÇÕES	2.000.000,00	0,30%	354.969.198,23	0,56%	8º I
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	6.452.532,86	0,96%	242.650.802,64	2,66%	9º II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	5.573.153,12	0,83%	161.950.670,21	3,44%	9º II
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	11.342.215,89	1,68%	31.540.544,66	35,96% ▲	9º II
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	12.615.925,10	1,87%	105.853.841,99	11,92%	10º I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	5.123.248,58	0,76%	131.219.088,81	3,90%	10º I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	1.991.116,97	0,29%	57.710.430,51	3,45%	10º I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	10.717.963,00	1,59%	135.091.004,95	7,93%	10º I
BB VOTORANTIM ENERGIA SUSTENTÁVEL II FIP INFRAESTRUTURA - ESUD11	107.900,99	0,02%	27.286.540,80	0,40%	10º II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	20.406.598,00	3,02%	2.935.852.465,15	0,70%	10º II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP MULTIESTRATÉGIA	689.056,91	0,10%	74.026.761,02	0,93%	10º II
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	31.428,41	0,00%	23.607.377,51	0,13%	10º II
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.364.394,94	0,35%	95.994.434,55	2,46%	10º II
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGI...	11.297.069,71	1,67%	360.376.474,66	3,13%	10º II

Investimentos

\$ 675.215.595,23

Disponibilidades Financeiras

\$ 194.869,50

Total Carteira

\$ 675.410.464,73

Governança (Pró Gestão)



Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	1.976.060,76	0,29%	107.892.917,70	1,83%	10º II
NOVA RAPOSO FIP MULTIESTRATÉGIA - NVRP11	1.280.940,42	0,19%	192.141.062,85	0,67%	10º II
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	198.006,00	0,03%	1.624.930.322,00	0,01%	11º
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	53.971,68	0,01%	10.386.410,16	0,52%	11º
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	2.927.994,81	0,43%	0,00		11º

Investimentos

\$ 675.215.595,23

Disponibilidades Financeiras

\$ 194.869,50

Total Carteira

\$ 675.410.464,73

Governança (Pró Gestão)



Título	Data Compra	Marcacao	Qtde	PU	Valor \$
NTN-B - 15/08/2040	15/07/2021	Curva - Taxa: 4,2800%	664	4.986,757244	3.311.206,81
NTN-B - 15/08/2040	26/07/2021	Curva - Taxa: 4,1850%	487	5.039,142641	2.454.062,47
NTN-B - 15/08/2040	23/08/2021	Curva - Taxa: 4,8200%	786	4.702,560161	3.696.212,29
NTN-B - 15/08/2040	22/09/2021	Curva - Taxa: 4,7900%	740	4.717,762555	3.491.144,29
NTN-B - 15/08/2040	26/10/2021	Curva - Taxa: 5,4500%	9.616	4.398,202124	42.293.111,62
NTN-B - 15/08/2040	29/10/2021	Curva - Taxa: 5,4900%	5.795	4.379,798792	25.380.934,00
NTN-B - 15/08/2040	23/11/2021	Curva - Taxa: 5,2700%	1.070	4.482,332236	4.796.095,49
NTN-B - 15/08/2040	17/12/2021	A mercado	3.380	4.378,884829	14.800.630,72
NTN-B - 15/08/2040	20/12/2021	Curva - Taxa: 5,2300%	4.550	4.501,326956	20.481.037,65
NTN-B - 15/08/2040	23/12/2021	Curva - Taxa: 5,1901%	2.480	4.520,387846	11.210.561,86
NTN-B - 15/08/2040	11/01/2022	Curva - Taxa: 5,6301%	2.350	4.316,18943	10.143.045,16
NTN-B - 15/08/2040	25/07/2022	Curva - Taxa: 6,2000%	1.500	4.070,234059	6.105.351,09
NTN-F - 01/01/2027	04/06/2018	Curva - Taxa: 11,1600%	8.169	986,331206	8.057.339,62
NTN-F - 01/01/2029	21/06/2018	Curva - Taxa: 11,8100%	37.673	950,455432	35.806.507,49
NTN-F - 01/01/2029	16/08/2018	Curva - Taxa: 11,6000%	14.670	957,914090	14.052.599,70

Investimentos

\$ 675.215.595,23

Disponibilidades Financeiras

\$ 194.869,50

Total Carteira

\$ 675.410.464,73

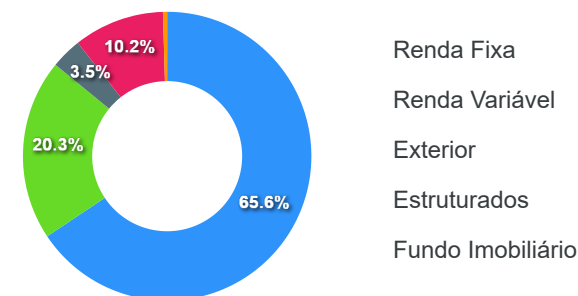
Governança (Pró Gestão)


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Utilizado (%)	Livre	
7º I a - Títulos TN SELIC	100,00%	30,55%	206.079.840,20	69,45%	468.471.478,51
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	19,23%	129.708.113,55	80,77%	544.843.205,16
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	5,55%	37.406.332,25	54,45%	367.324.458,98
7º IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	6,88%	46.436.757,45	13,12%	88.473.506,29
7º V a - FIDC Cota Sênior	5,00%	0,10%	663.278,83	4,90%	33.064.287,11
7º V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	3,39%	22.853.015,84	1,61%	10.874.550,10
8º I - Fundos de Ações	30,00%	20,30%	136.918.678,96	9,70%	65.446.716,65
9º II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,46%	23.367.901,87	6,54%	44.087.230,00
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	4,51%	30.448.253,65	5,49%	37.006.878,22
10º II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	5,66%	38.153.450,14	-0,66%	-4.425.884,20
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,47%	3.179.972,49	4,53%	30.547.593,45

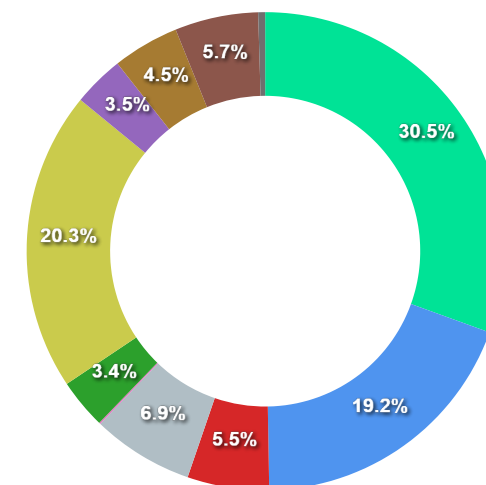
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos



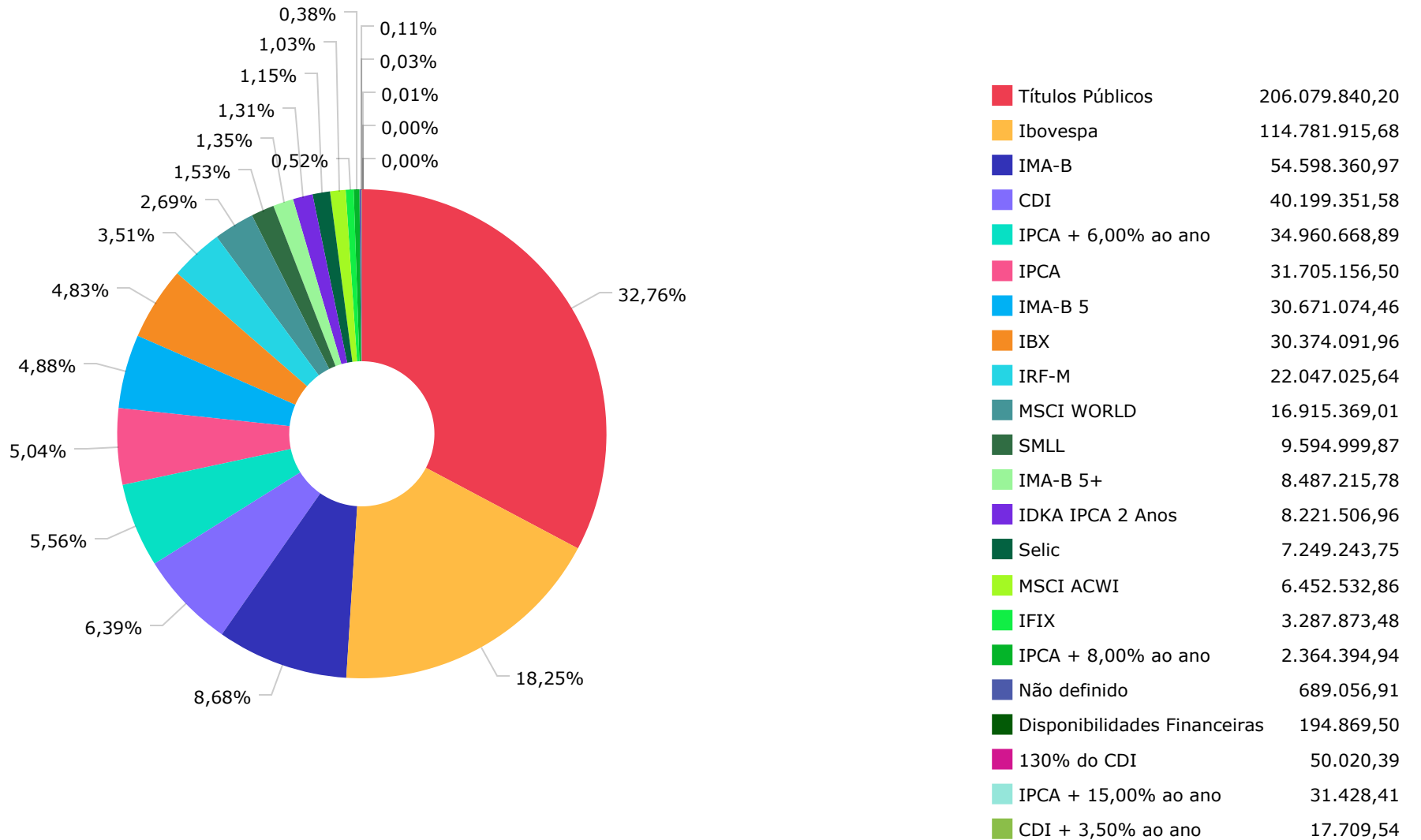
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	30,55%	0,00%	33,00%	100,00%	468.471.478,51	8° I - Fundos de Ações	20,30%	0,00%	25,00%	40,00%	132.901.848,52
7° I b - FI 100% Títulos TN	19,23%	0,00%	10,00%	100,00%	544.843.205,16	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	269.820.527,48
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	674.551.318,71	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	67.455.131,87
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	33.727.565,94	9° II - Constituídos no Brasil	3,46%	0,00%	4,00%	10,00%	44.087.230,00
7° III a - FI Referenciados RF	5,55%	0,00%	1,00%	70,00%	434.779.590,85	9° III - Ações - BDR Nível I	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	67.455.131,87
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	70,00%	472.185.923,10	10° I - Fundos Multimercados	4,51%	0,00%	5,00%	10,00%	37.006.878,22
7° IV - Ativos Financeiros de ...	6,88%	0,00%	5,00%	20,00%	88.473.506,29	10° II - Fundos em Participaçõ...	5,66%	0,00%	3,00%	5,00%	-4.425.884,20
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,10%	0,00%	1,00%	10,00%	66.791.853,04	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	33.727.565,94
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	3,39%	0,00%	10,00%	10,00%	44.602.116,03	11° - Fundos Imobiliários	0,47%	0,00%	1,00%	10,00%	64.275.159,38
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	67.455.131,87	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	67.455.131,87

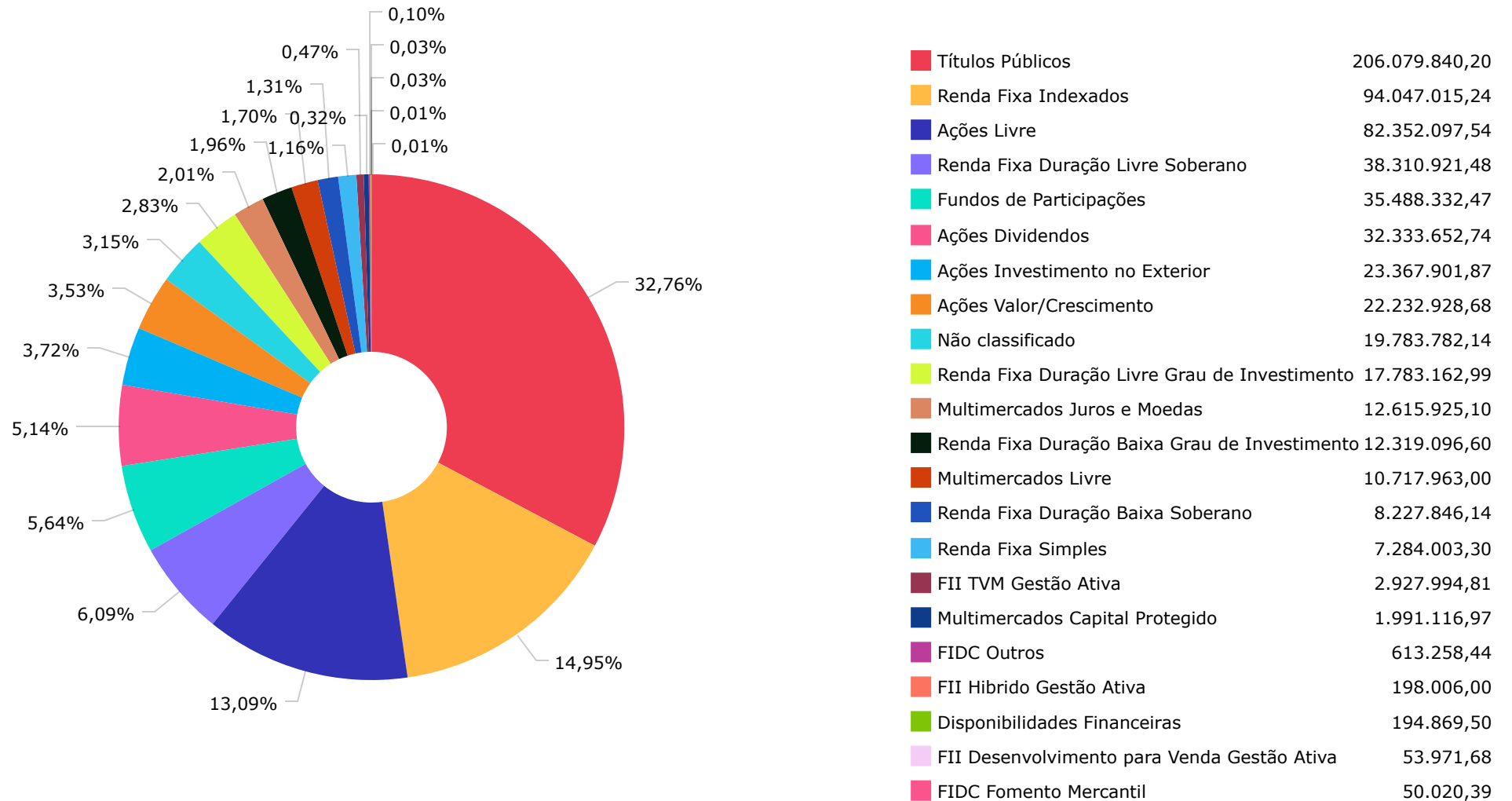
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP MULTISTRATÉGIA	-2,39		-7,09					
130% DO CDI - BENCHMARK								
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	1,48	11,68	4,33	8,75	17,93	33,79		
CDI - BENCHMARK								
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,19	9,25	3,44	6,92	14,22	27,26	0,02	0,04
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,63	11,86	4,24	10,77	13,79	24,76	1,12	2,36
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13	8,74	3,28	6,58	13,41	24,94	0,01	0,01
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,05	8,15	3,06	6,14	12,44	22,65	0,01	0,03
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,56	6,65	3,97	6,69	11,84	24,69	0,15	0,31
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,45	-8,83	-1,41	-8,73	0,98	-59,62	0,07	0,14
CDI + 3,50% AO ANO - BENCHMARK								
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	16,36	64,20	391,59		78,77	-76,46		
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,33	2,56	1,27	2,04	-11,85	-60,57		
IBOVESPA - BENCHMARK								
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-4,33	17,04	8,67	19,35	16,34	19,10	6,05	12,74
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,11	8,40	6,09	10,49	9,21	20,73	6,42	13,53
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	-2,69	4,72	3,18	5,54	6,91		3,07	6,46
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	-5,30	5,28	5,48	11,22	4,76	3,23	6,14	12,93
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,01	3,38	7,19	7,46	4,30	-6,59	5,66	11,92
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-6,15	3,95	8,03	8,05	0,15	-10,75	8,01	16,88
OCCAM FIC AÇÕES	-5,77	1,34	6,76	5,41	-0,36	-5,56	6,59	13,89
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	0,31	5,20	2,29	4,46	-0,56	2,71	1,65	3,47

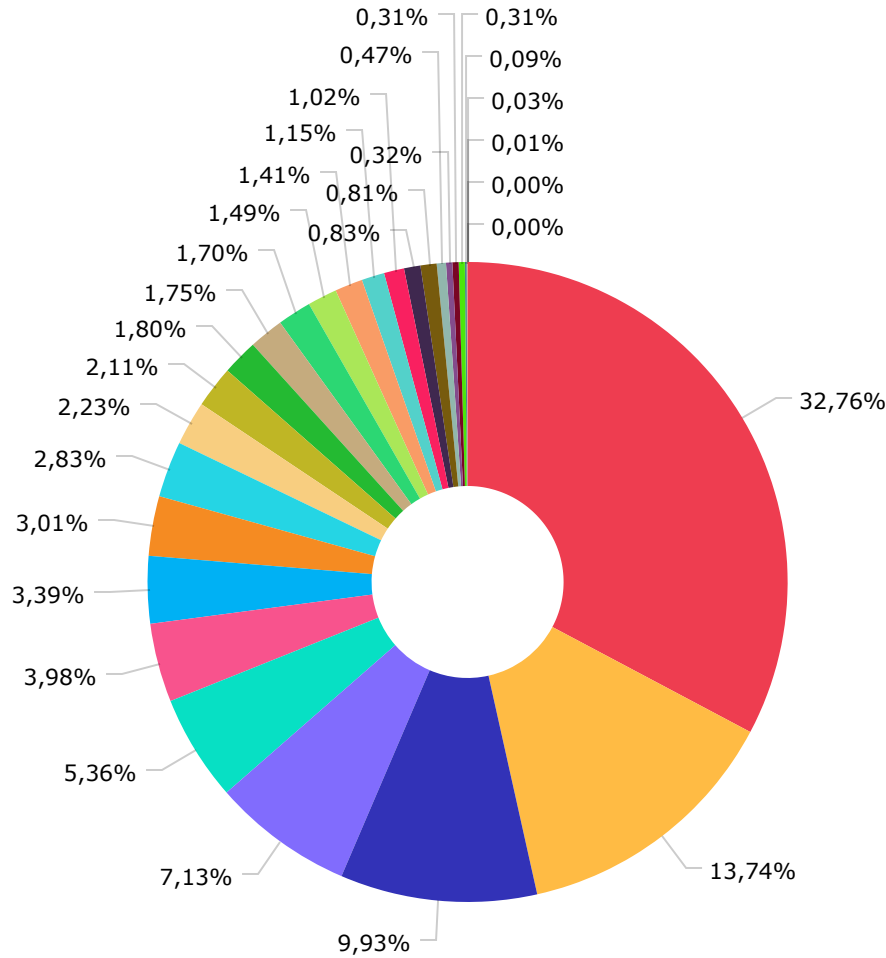
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-7,18	2,03	4,64	4,03	-2,33	-28,58	6,91	14,56
BB AGRO FIC AÇÕES	-3,41	1,03	6,38	3,48	-2,53	2,21	6,57	13,84
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-5,78	0,26	6,07	8,21	-2,61	-8,70	6,38	13,45
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	-1,40		2,52				2,80	5,91
IBX - BENCHMARK	-5,01	4,62	6,85	9,37	4,16	-4,36		
SPX APACHE FIC AÇÕES	-5,74	15,37	6,92	16,45	14,84	7,16	5,55	11,68
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	-4,16	5,79	8,41	8,64	2,49	1,09	7,10	14,95
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-6,24	6,99	6,37	10,14	0,90	-14,13	8,39	17,67
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,77	8,66	2,75	5,42	11,80	22,33		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74	8,36	2,73	5,26	11,57	21,91	0,92	1,93
IMA-B - BENCHMARK	-0,38	11,84	2,83	10,43	13,76	20,07		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,37	11,72	2,79	10,37	13,51	19,64	1,71	3,61
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,45	11,66	2,71	10,33	13,48	19,44	1,77	3,73
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,64	6,44	0,20	7,89	7,85	8,37	4,15	8,75
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,66	1,89	0,30	2,08	5,14	8,19	4,00	8,43
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,70	1,82	0,26	2,05	5,09	8,21	4,08	8,60
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,61	8,75	2,66	5,76	11,97	23,03		
BTG PACTUAL TESOURO CURTO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA	0,59	8,59	2,61	5,65	11,74	22,55	0,95	1,99
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,95	0,70	-0,06	1,68	4,00	-45,25	4,41	9,28
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-1,27	14,28	2,80	14,40	15,00	16,66		
SANTANDER IMA-B 5+ PREMIUM FIC RENDA FIXA	-1,28	13,94	2,71	14,03	14,58	15,77	2,65	5,59
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,29	13,97	2,68	14,11	14,56	15,81	2,67	5,62

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IPCA - BENCHMARK	0,23	3,23	0,27	1,83	4,61	13,74		
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04	10,75	3,67	8,97	14,02	22,87	0,10	0,22
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,83	8,62	2,83	5,70	11,83	22,69	0,73	1,54
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90	7,61	2,91	4,74	11,04	22,28	0,62	1,30
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91		2,95				0,62	1,31
IPCA + 15,00% AO ANO - BENCHMARK	1,52	13,31	3,84	9,20	20,30	50,42		
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	-2,48	-35,74	-14,45	-18,88		-95,03	0,04	0,09
IPCA + 8,00% AO ANO - BENCHMARK	0,94	8,67	2,22	5,83	12,98	32,66		
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-0,21	7,91	-0,50	0,56	0,21	4,14		
IRF-M - BENCHMARK	0,76	11,43	3,81	9,56	14,96	22,06		
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73	11,25	3,74	9,42	14,65	21,46	1,05	2,22
SELIC - BENCHMARK	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,27	9,16	3,63	7,00	14,06	26,49	0,02	0,04
SMLL - BENCHMARK	-7,43	8,13	3,26	17,40	-1,94	-23,76		
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-5,79	6,75	6,16	9,59	0,68	-13,76	7,58	15,96
IPCA + 6,00% AO ANO - BENCHMARK	0,76	7,32	1,74	4,84	10,88	27,80		
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,20	15,89	-0,63	16,12	15,41	66,13		
NOVA RAPOSO FIP MULTIESTRATÉGIA - NVRP11	-0,07	-0,56	-0,20	-0,42	11,74	-59,27	0,00	0,00
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	0,64	-5,23	1,21	0,60	-7,16			
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,65	-6,77	-1,96	-4,29				

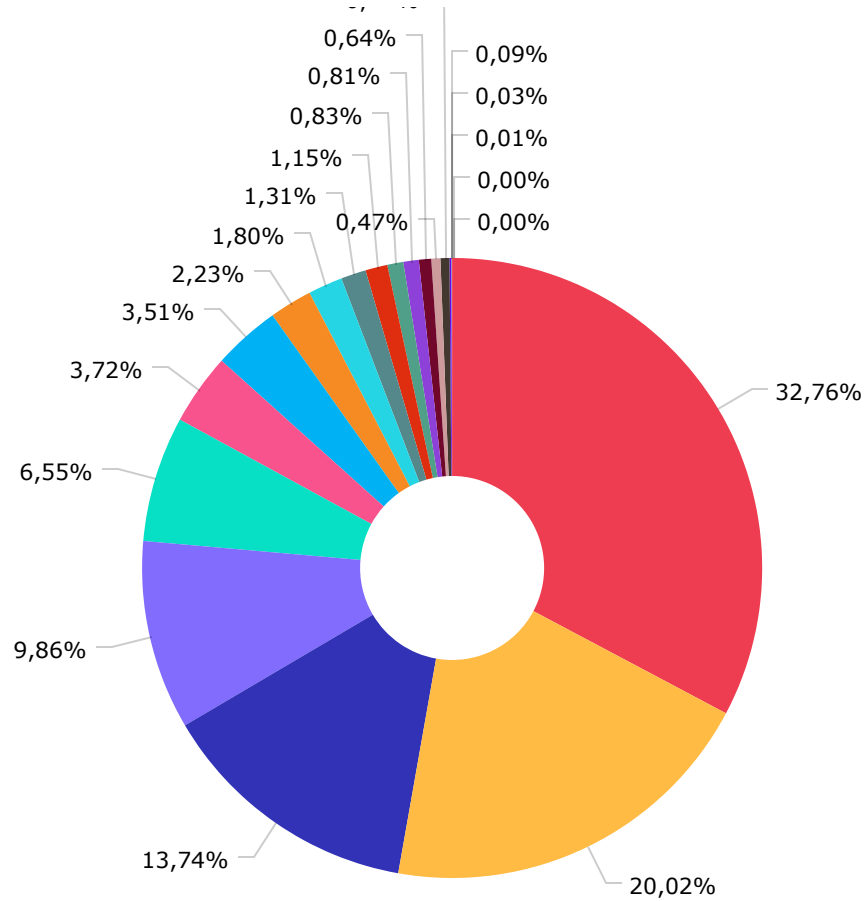
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
MSCI WORLD - BENCHMARK	1,15	8,22	2,98	3,96	8,01	-9,04		
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	1,95	3,34	1,82	1,30	4,48	-14,37	7,34	15,46
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-4,99	21,14	4,25	7,99	-4,03	-56,90	12,09	25,47
MSCI ACWI - BENCHMARK	0,73	6,92	2,53	3,09	6,36	-11,42		
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇ...	-0,43	31,06	12,53	20,70	17,87	-17,62	8,80	18,53
IFIX - BENCHMARK	0,49	12,06	6,62	14,40	7,95	16,84		
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	-9,99	3,01	4,11	15,31	-13,35	-21,62	9,40	19,79
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	0,00	0,00	-13,85	-17,65	-41,05	-73,71	13,64	28,72
BB VOTORANTIM ENERGIA SUSTENTÁVEL II FIP INFRAESTRUTURA - ESUD11	0,47	-82,51	-38,09	-82,49	-80,98	-81,15	0,01	0,02
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11							0,00	0,00







TESOURO NACIONAL	206.079.840,20
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	86.442.283,14
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	62.488.537,45
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	44.834.565,42
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	33.716.392,74
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	25.027.873,81
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECU...	21.343.210,36
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSO...	18.959.479,59
XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT...	17.794.748,75
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DT...	14.004.766,51
BANCO J. SAFRA S.A	13.297.698,99
KINEA INVESTIMENTOS LTDA.	11.351.041,39
ARX INVESTIMENTOS LTDA	10.990.442,38
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	10.717.963,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	9.383.357,32
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	8.846.602,21
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	7.249.243,75
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	6.406.175,29
CLARITAS ADMINISTRAÇÃO DE RECU...	5.212.587,27
CAIXA DTVM	5.123.248,58
PLANNER CORRETORA DE VALORES S...	2.927.994,81
SPX EQUITIES GESTAO DE RECURSO...	2.000.000,00
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	1.976.060,76
ALASKA INVESTIMENTOS LTDA	1.941.445,23
PETRA CAPITAL GESTÃO DE INVEST...	595.548,90
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	194.869,50
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIR...	50.020,39
VILA RICA CAPITAL GESTORA DE R...	17.131,43
GENIAL GESTÃO LTDA	578,11



TESOURO NACIONAL	206.079.840,20
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	125.908.642,45
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	86.442.283,14
BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIR...	62.034.159,33
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	41.204.036,26
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	23.367.901,87
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	22.047.025,64
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DT...	14.004.766,51
LIONS TRUST ADMINISTRADORA DE ...	11.297.069,71
SAFRA SERVICOS DE ADMINISTRAÇÃ...	8.227.846,14
BANCO BRADESCO S.A.	7.249.243,75
SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRI...	5.244.015,68
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	5.069.852,85
INTRAG DTVM LTDA	4.030.032,44
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	2.980.848,17
PLANNER CORRETORA DE VALORES S...	2.927.994,81
FINAXIS CORRETORA DE TÍTULOS E...	595.548,90
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	194.869,50
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIR...	50.020,39
BRL TRUST DISTRIBUIDORA DE TÍT...	17.131,43
GENIAL INVESTIMENTOS CORRETORA...	578,11

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	600.584.139,92	19.085.861,29	11.314.283,31	618.596.174,60	10.240.456,70	10.240.456,70	1,68% ▲	1,68%	0,91%	0,91%	184,62%	3,21%
Fevereiro	618.596.174,60	19.939.471,71	46.787.332,60	586.057.094,04	-5.691.219,67	4.549.237,03	-0,92% ▼	0,75%	1,14%	2,06%	36,41%	3,01%
Março	586.057.094,04	77.276.935,80	44.717.310,63	624.358.235,24	5.741.516,03	10.290.753,06	0,93% ▲	1,68%	1,11%	3,19%	52,66%	2,56%
Abril	624.358.235,24	28.944.809,17	25.688.171,08	632.721.250,87	5.106.377,54	15.397.130,60	0,81% ▲	2,51%	0,90%	4,11%	61,07%	2,30%
Mai	632.721.250,87	148.389.636,62	144.988.932,15	646.047.362,77	9.925.407,43	25.322.538,03	1,56% ▲	4,11%	0,81%	4,95%	83,03%	1,92%
Junho	646.047.362,77	59.101.582,00	55.746.132,62	665.692.841,52	16.290.029,37	41.612.567,40	2,51% ▲	6,72%	0,33%	5,30%	126,79%	2,19%
Julho	665.692.841,52	23.394.367,65	21.381.284,15	677.111.644,34	9.405.719,32	51.018.286,72	1,41% ▲	8,22%	0,34%	5,65%	145,49%	2,23%
Agosto	677.111.644,34	61.381.248,65	58.013.844,25	675.215.595,23	-5.263.453,51	45.754.833,21	-0,77% ▼	7,39%	0,67%	6,35%	116,38%	2,21%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	10.290.753,06	1,68%	3,19%
2º Trim	31.321.814,34	4,95%	2,04%
1º Sem	41.612.567,40	6,72%	5,30%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

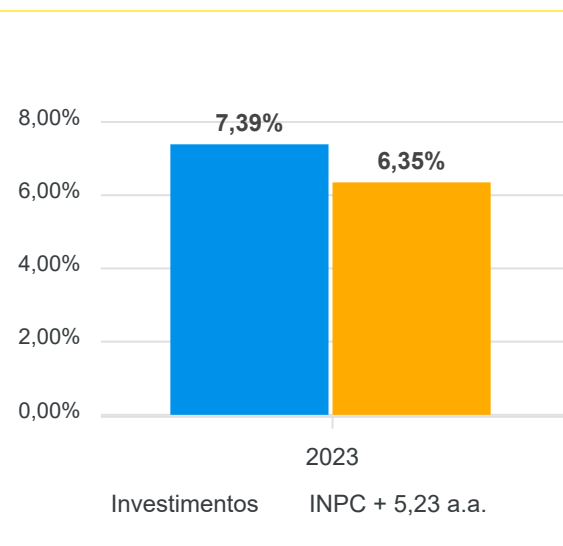


Gráfico Risco x Retorno

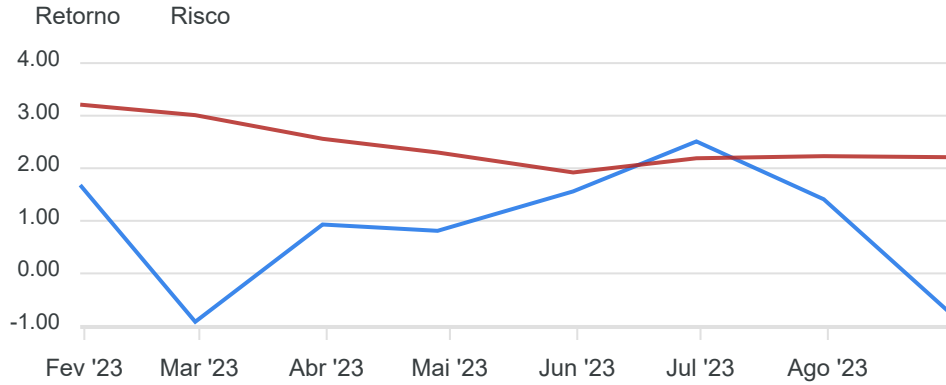
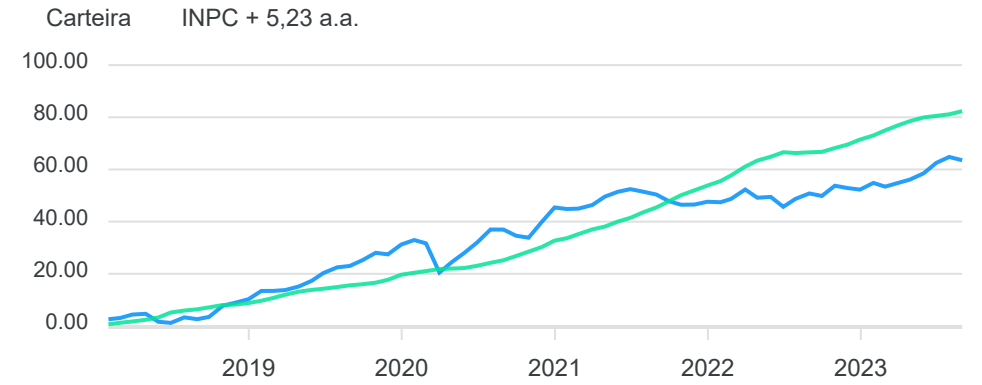
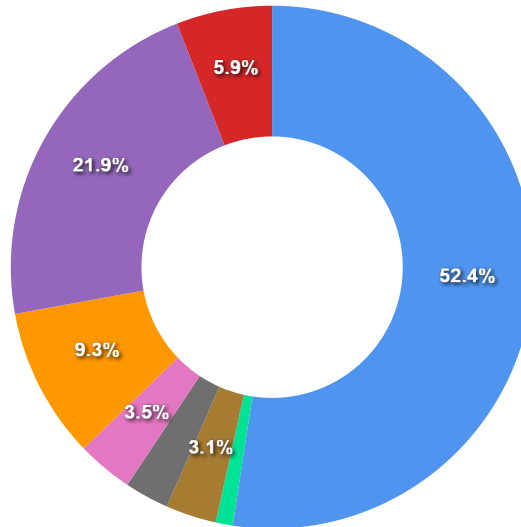


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/08/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	353.984.180,81	52,43
Até D+180	7.154.032,50	1,06
Até D+360	21.158.575,56	3,13
Até D+720	18.543.285,59	2,75
Até D+1800	23.387.788,12	3,46
Até D+3600	62.998.568,06	9,33
Acima D+3600	148.163.393,45	21,94
Indeterminado	40.020.640,70	5,93



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
TÍTULOS PÚBLICOS	208.766.588,62	0,00	4.079.908,86	206.079.840,20	1.393.160,44	0,67% ▲	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.313.525,82	13.862.546,45	8.960.954,80	7.284.003,30	68.885,83	0,43% ▲	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.161.176,90	0,00	0,00	8.221.506,96	60.330,06	0,74% ▲	0,92%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.115.051,30	2.500.000,00	2.042.204,45	5.506.367,61	-66.479,24	-0,87% ▼	2,67%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.800.046,47	9.186.752,69	0,00	22.873.085,20	-113.713,96	-0,49% ▼	1,77%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	11.283.416,69	0,00	0,00	11.376.987,70	93.571,01	0,83% ▲	0,73%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.464.509,09	0,00	15.586.572,24	0,00	122.063,15	0,79% ▲	0,18%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	102.890,62	0,00	103.575,95	0,00	685,33	0,67% ▲	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.238.136,79	0,00	353.202,50	11.995.415,89	110.481,60	0,90% ▲	0,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.408.274,12	0,00	127.664,28	4.319.867,86	39.258,02	0,89% ▲	0,62%
BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	2.075.367,33	0,00	2.078.466,64	0,00	3.099,31	0,15% ▲	0,06%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.084.715,22	2.078.588,54	0,00	7.249.243,75	85.939,99	1,20% ▲	0,02%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.805.778,36	0,00	81.115,26	2.751.023,08	26.359,98	0,94% ▲	4,41%
BTG PACTUAL INFRA-B FI INFRA RENDA FIXA	195.779,38	0,00	196.359,60	0,00	580,22	0,30% ▲	1,45%
BTG PACTUAL TESOURO CURTO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA	27.755.414,62	0,00	0,00	27.920.051,38	164.636,76	0,59% ▲	0,95%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.716.671,69	0,00	200.701,28	7.585.155,02	69.184,61	0,90% ▲	4,08%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.612.004,00	0,00	168.599,76	6.502.529,60	59.125,36	0,89% ▲	4,00%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.495.208,88	0,00	321.901,41	13.139.460,87	-33.846,60	-0,25% ▼	4,15%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	772.257,37	3.753.087,14	0,00	4.498.130,28	-27.214,23	-0,60% ▼	1,71%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	17.074,36	0,00	0,00	17.131,43	57,07	0,33% ▲	-
LETRA FINANCEIRA BTG	25.095.421,54	0,00	0,00	25.178.948,46	83.526,92	0,33% ▲	-
LF BTG 18/05/2026 IPCA + 6,10%	15.216.526,79	0,00	0,00	15.330.448,50	113.921,71	0,75% ▲	-
LF BTG 26/05/2025 IPCA + 6,93%	5.882.485,45	0,00	0,00	5.927.360,49	44.875,04	0,76% ▲	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	496,82	0,00	0,00	578,11	81,29	16,36% ▲	-
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	48.107,81	0,00	0,00	50.020,39	1.912,58	3,98% ▲	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	598.226,14	0,00	0,00	595.548,90	-2.677,24	-0,45% ▼	0,07%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.010.333,15	0,00	0,00	5.069.852,85	59.519,70	1,19% ▲	0,02%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.135.700,07	0,00	0,00	8.227.846,14	92.146,07	1,13% ▲	0,01%
SANTANDER IMA-B 5+ PREMIUM FIC RENDA FIXA	3.019.643,39	0,00	0,00	2.980.848,17	-38.795,22	-1,28% ▼	2,65%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	13.207.739,84	0,00	13.330.034,88	0,00	122.295,04	0,93% ▲	0,06%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA	10.297.972,05	0,00	10.381.121,64	0,00	83.149,59	0,81% ▲	0,18%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	6.307.881,20	0,00	0,00	6.406.175,29	98.294,09	1,56% ▲	0,15%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	4.000.000,00	0,00	4.012.885,05	12.885,05	0,32% ▲	0,10%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	22.000.273,83	0,00	22.047.025,64	46.751,81	0,21% ▲	1,05%
	441.004.421,88	57.381.248,65	58.012.383,55	443.147.338,12	2.774.051,14	0,63%	0,61%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
ALASKA INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.029.323,55	0,00	0,00	1.941.445,23	-87.878,32	-4,33% ▼	6,05%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.664.934,26	0,00	0,00	10.990.442,38	-674.491,88	-5,78% ▼	6,38%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	12.869.100,67	0,00	0,00	12.078.060,86	-791.039,81	-6,15% ▼	8,01%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	24.702.749,06	0,00	0,00	23.161.504,69	-1.541.244,37	-6,24% ▼	8,39%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.185.094,99	0,00	0,00	9.594.999,87	-590.095,12	-5,79% ▼	7,58%
BB AGRO FIC AÇÕES	11.235.132,89	0,00	0,00	10.852.163,57	-382.969,32	-3,41% ▼	6,57%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.757.116,30	0,00	0,00	8.127.978,73	-629.137,57	-7,18% ▼	6,91%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	5.438.986,46	0,00	0,00	5.212.587,27	-226.399,19	-4,16% ▼	7,10%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	22.234.170,53	0,00	0,00	21.343.210,36	-890.960,17	-4,01% ▼	5,66%
OCCAM FIC AÇÕES	20.119.375,08	0,00	0,00	18.959.479,59	-1.159.895,49	-5,77% ▼	6,59%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.378.629,67	0,00	0,00	3.273.449,09	-105.180,58	-3,11% ▼	6,42%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	9.908.347,13	0,00	0,00	9.383.357,32	-524.989,81	-5,30% ▼	6,14%
SPX APACHE FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.000.000,00	0,00	0,00%	5,55%
-	142.522.960,59	2.000.000,00	0,00	136.918.678,96	-7.604.281,63	-5,26%	6,91%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB VOTORANTIM ENERGIA SUSTENTÁVEL II FIP INFRAESTRUTURA - ESUD11	107.397,23	0,00	0,00	107.900,99	503,76	0,47% ▲	0,01%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	20.447.893,02	0,00	0,00	20.406.598,00	-41.295,02	-0,20% ▼	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP MULTIESTRATÉGIA	705.961,93	0,00	0,00	689.056,91	-16.905,02	-2,39% ▼	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	32.228,44	0,00	0,00	31.428,41	-800,03	-2,48% ▼	0,04%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.369.316,06	0,00	0,00	2.364.394,94	-4.921,12	-0,21% ▼	-
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	12.536.823,78	0,00	0,00	12.615.925,10	79.101,32	0,63% ▲	1,12%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	5.196.002,99	0,00	0,00	5.123.248,58	-72.754,41	-1,40% ▼	2,80%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	11.224.787,34	0,00	0,00	11.297.069,71	72.282,37	0,64% ▲	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	1.989.041,37	0,00	0,00	1.976.060,76	-12.980,61	-0,65% ▼	-
NOVA RAPOSO FIP MULTIESTRATÉGIA - NVRP11	1.281.872,51	0,00	0,00	1.280.940,42	-932,09	-0,07% ▼	0,00%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	11.014.652,00	0,00	0,00	10.717.963,00	-296.689,00	-2,69% ▼	3,07%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	1.991.116,97	-8.883,03	-0,44% ▼	1,65%
-	66.905.976,67	2.000.000,00	0,00	68.601.703,79	-304.272,88	-0,44%	0,94%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	219.981,42	0,00	1.460,70	198.006,00	-20.514,72	-9,33% ▼	9,40%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	53.971,68	0,00	0,00	53.971,68	0,00	0,00%	13,64%
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	2.932.757,74	0,00	0,00	2.927.994,81	-4.762,93	-0,16% ▼	0,00%
-	3.206.710,84	0,00	1.460,70	3.179.972,49	-25.277,65	-0,79%	0,82%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇ...	6.480.718,85	0,00	0,00	6.452.532,86	-28.185,99	-0,43% ▼	8,80%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	5.865.715,55	0,00	0,00	5.573.153,12	-292.562,43	-4,99% ▼	12,09%
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	11.125.139,96	0,00	0,00	11.342.215,89	217.075,93	1,95% ▲	7,34%
	23.471.574,36	0,00	0,00	23.367.901,87	-103.672,49	-0,44%	5,31%

Cenário Econômico

Após uma sequência de meses no positivo, quem possui investimentos em uma carteira diversificada, acabou, provavelmente, fechando a rentabilidade no campo negativo. Na renda fixa, sinais mistos, com a abertura da curva de juros, os fundos atrelados a inflação mais longos fecharam no negativo. Mas os investimentos em títulos públicos e juros mais curtos tiveram rentabilidade positiva. A renda variável local, com o fraco desempenho do Ibovespa, fez com o que os fundos fechassem em forte baixa, e por fim os fundos com investimentos ligados nos ativos no exterior, prejudicado pelos desempenhos ruins das economias globais, fecharam o mês igualmente no negativo. Mas, mesmo com o resultado ruim deste mês, o número não foi suficiente para afetar a rentabilidade positiva no acumulado deste ano, e a maioria dos RPPS seguem com boa folga frente as suas respectivas metas atuariais.

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, apesar do realinhamento das taxas de juros no longo prazo provocando rentabilidade não satisfatória nos fundos IMA's e títulos públicos federais com marcação a mercado, as estratégias de investimentos de menor prazo como em CDI seguem com rentabilidade competitiva. Como já dissemos na análise do cenário econômico, a renda variável local, com o fraco desempenho do Ibovespa, fez com o que os fundos fechassem em baixa, junto com os fundos com investimentos ligados aos ativos no exterior, prejudicados pelos desempenhos ruins das economias globais.

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, 13 de setembro de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

