

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	826.517,63	0,36%	6.063.437.379,24	0,01%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.286.231,02	1,42%	5.367.605.963,99	0,06%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.117.214,14	4,38%	2.459.230.011,04	0,41%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	548.477,46	0,24%	488.601.272,15	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.776.773,75	7,27%	1.779.752.599,75	0,94%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.682.271,42	1,60%	5.614.661.167,38	0,07%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	150.635,54	0,07%	5.412.384.350,74	0,00%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.792.278,86	5,98%	8.162.684.334,70	0,17%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	26.184.023,80	11,35%	5.222.821.325,49	0,50%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.047.379,31	2,19%	7.513.988.203,57	0,07%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.618.784,62	2,00%	2.124.960.940,76	0,22%	7º I b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	725.525,21	0,31%	13.380.727.353,70	0,01%	7º I b
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.300.819,75	1,00%	1.020.321.787,36	0,23%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.877.728,98	1,25%	15.259.689.366,93	0,02%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.557.762,12	1,11%	569.383.114,96	0,45%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.671.395,72	6,36%	8.906.699.435,49	0,16%	7º III a
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.815.682,52	1,65%	754.235.941,18	0,51%	7º III a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	10.843.286,13	4,70%	5.816.586.914,15	0,19%	7º III a
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	9.567.918,92	4,15%	470.464.896,61	2,03%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.835.273,54	5,13%	5.271.171.485,51	0,22%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	6.886.241,02	2,98%	2.836.954.249,95	0,24%	7º III a
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.516.811,55	4,56%	2.788.665.794,77	0,38%	7º III a
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.660.609,63	0,72%	2.528.521.161,64	0,07%	7º V b
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	996.714,07	0,43%	69.291.875,24	1,44%	8º I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.373.532,97	2,33%	809.353.434,17	0,66%	8º I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2.893.362,43	1,25%	497.500.211,96	0,58%	8º I
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	911.681,08	0,40%	29.521.721,53	3,09%	8º I

Investimentos

\$ 230.797.743,41

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 230.797.743,41

Governança (Pró Gestão)



Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.014.903,99	0,44%	723.327.375,54	0,14%	8º I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.962.529,99	0,85%	339.887.937,49	0,58%	8º I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	9.636,66	0,00%	246.788.160,09	0,00%	8º I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	106.265,04	0,05%	436.527.259,61	0,02%	8º I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	410.168,61	0,18%	402.802.144,85	0,10%	8º I
OCCAM FIC AÇÕES	3.518.635,99	1,52%	809.855.751,72	0,43%	8º I
SAFRA SMALL CAP PB FIC AÇÕES	2.544.953,34	1,10%	62.648.771,79	4,06%	8º I
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	10.181.763,53	4,41%	129.130.196,01	7,88%	8º I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.057.424,28	4,36%	798.855.247,18	1,26%	8º I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.422.017,10	2,78%	1.077.140.960,13	0,60%	8º I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.692.951,83	0,73%	350.106.562,64	0,48%	9º III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	887.106,55	0,38%	446.292.351,73	0,20%	9º III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	5.557.631,13	2,41%	630.573.105,28	0,88%	10º I
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.124.116,45	0,49%	1.550.573.133,57	0,07%	10º I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	536.423,99	0,23%	571.203.704,71	0,09%	10º I
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	1.998.591,98	0,87%	304.104.012,39	0,66%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	9.307.689,76	4,03%	1.122.626.979,16	0,83%	10º I

Investimentos

\$ 230.797.743,41

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 230.797.743,41

Governança (Pró Gestão)

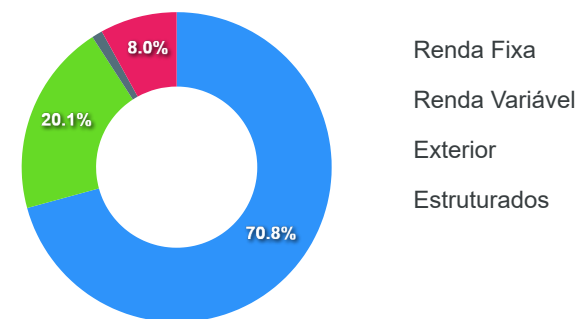


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	38,15% 88.056.932,51	61,85% 142.740.810,90
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	31,88% 73.572.100,50	28,12% 64.906.545,55
7º V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	0,72% 1.660.609,63	4,28% 9.879.277,54
8º I - Fundos de Ações	30,00%	20,11% 46.403.589,08	9,89% 22.835.733,94
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,12% 2.580.058,38	8,88% 20.499.715,96
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	8,03% 18.524.453,31	1,97% 4.555.321,03

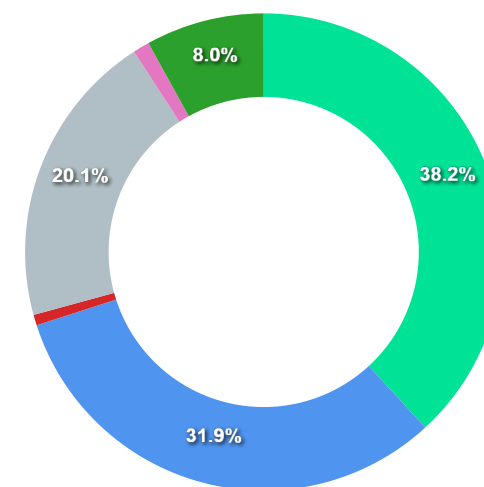
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos

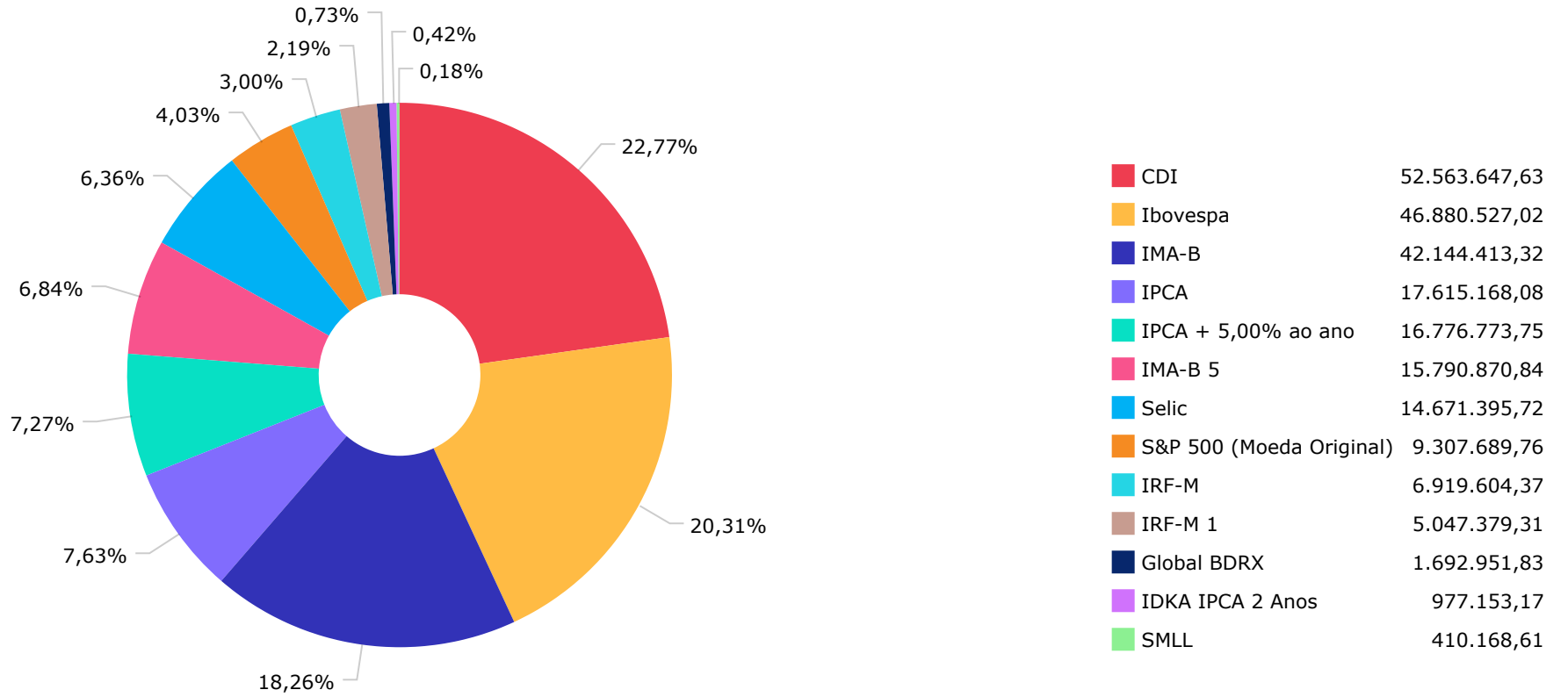


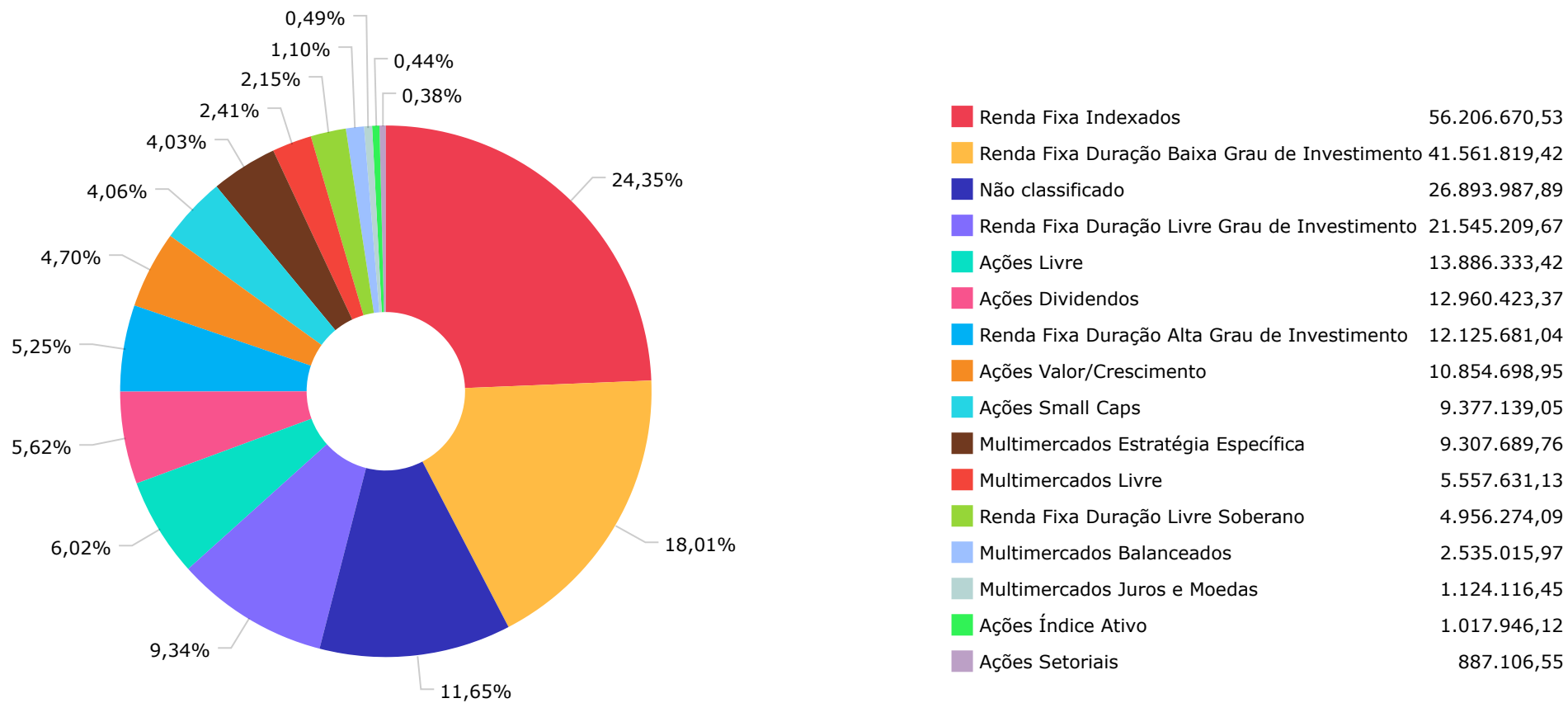
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	230.797.743,41	8° I - Fundos de Ações	20,11%	0,00%	27,00%	30,00%	22.835.733,94
7° I b - FI 100% Títulos TN	38,15%	0,00%	32,00%	100,00%	142.740.810,90	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	69.239.323,02
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	230.797.743,41	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	23.079.774,34
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.539.887,17	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	23.079.774,34
7° III a - FI Referenciados RF	31,88%	0,00%	15,00%	60,00%	64.906.545,55	9° III - Ações - BDR Nível I	1,12%	0,00%	5,00%	10,00%	20.499.715,96
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	138.478.646,05	10° I - Fundos Multimercados	8,03%	0,00%	8,00%	10,00%	4.555.321,03
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	46.159.548,68	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.539.887,17
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.539.887,17	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.539.887,17
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,72%	0,00%	1,00%	5,00%	9.879.277,54	11° - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.539.887,17
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.539.887,17	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	11.539.887,17

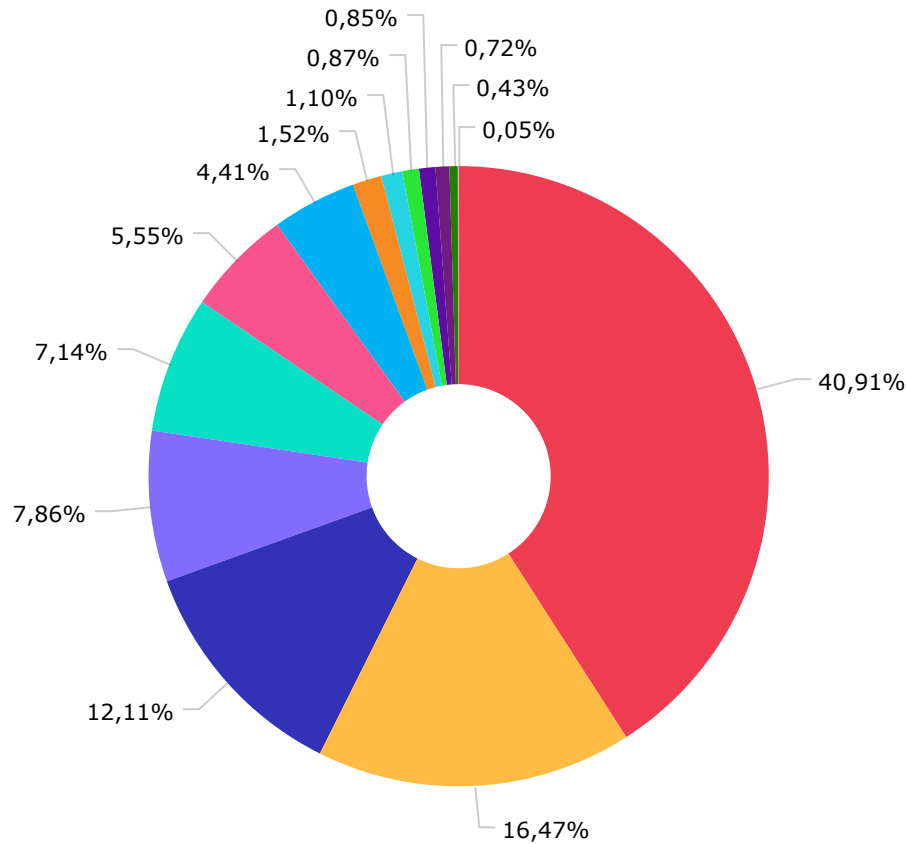
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80		
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,06	10,41	3,38	6,74	14,17	27,92	0,06	0,13
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05	10,23	3,54	6,91	13,89	27,22	0,03	0,06
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,02	10,12	3,52	6,89	13,72	26,84	0,01	0,03
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,02	10,15	3,42	6,85	13,67	26,52	0,02	0,04
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
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 JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,86	9,52	2,78	6,24	12,70	26,53	0,12	0,25
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,42	9,32	2,07	5,81	12,21	24,91	0,59	1,25
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,90	8,06	1,93	7,76	9,73	20,93	2,15	4,52
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,85	7,39	1,94	6,31	9,60	23,26	1,95	4,11
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	-3,46	17,23	1,81	7,82	21,85	-5,29		
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,66	10,28	-2,13	3,34	20,49	3,74	5,71	12,03
IBOVESPA - BENCHMARK	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03		
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,25	20,50	8,81	25,22	26,65	33,62	9,54	20,09
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,02	14,38	8,16	23,03	17,39	13,25	9,80	20,64
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,35	29,82	1,07	16,55	16,22	-16,75	6,92	14,57
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	0,24	16,74	0,98	21,94	12,41	7,63	6,49	13,68
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-0,29	14,58	-4,52	17,03	11,80	8,54	6,89	14,52
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,21	9,80	-0,03	16,93	11,01	17,35	6,87	14,46
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,12	11,80	-1,69	17,93	10,85	13,29	8,45	17,80
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,04	9,55	-2,31	16,87	7,47	13,87	7,48	15,76
SAFRA SMALL CAP PB FIC AÇÕES	-4,11	13,89	-2,63	16,51	5,80	-12,03	8,43	17,75
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,07	5,26	-1,86	13,49	3,70	0,31	7,48	15,76
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	-1,13	4,09	-3,27	11,56	1,22	10,10	7,28	15,34

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
OCCAM FIC AÇÕES	0,79	2,14	-2,31	9,30	0,55	2,27	7,05	14,84
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,26	2,02	-1,96	10,30	-0,01	-4,02	7,72	16,25
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	-1,02	0,05	-4,92	8,62	-0,03	0,32	8,75	18,43
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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21	8,59	1,90	4,04	11,22	20,92	0,85	1,80
IMA-B - BENCHMARK	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09		
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
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,13	10,65	-0,74	6,40	10,68	18,20	2,57	5,42
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,26	10,64	-0,98	6,42	10,10	16,54	2,73	5,75
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10	2,97	0,46	1,90	5,75	8,32	0,33	0,70
IMA-B 5 - BENCHMARK	0,13	8,89	1,73	4,32	11,65	21,97		
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	-0,07	13,42	0,89	8,50	19,88	26,92	3,11	6,56
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
IPCA - BENCHMARK	0,26	3,50	0,61	1,38	5,19	12,73		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40	10,36	1,94	6,89	12,82	23,47	0,60	1,26
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,45	10,01	2,08	6,48	12,18	23,72	0,54	1,14
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11		3,12				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
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14	11,40	1,75	7,30	13,26	22,03	1,13	2,37

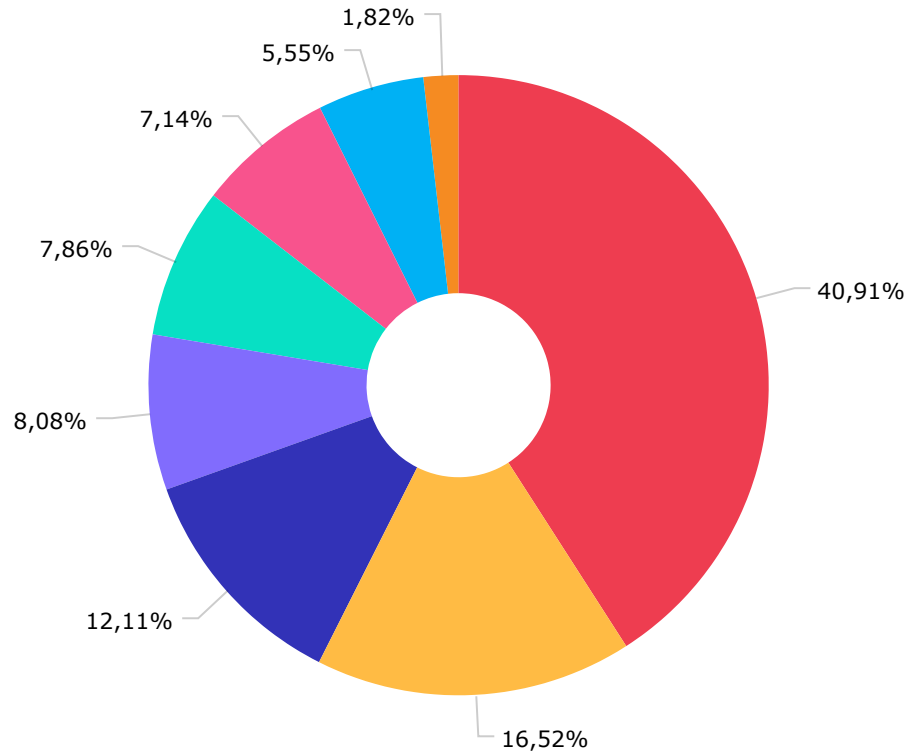
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,93	10,06	3,18	6,50	13,54	24,68		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91	9,91	3,12	6,37	13,31	24,16	0,07	0,15
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	-4,87	11,68	-3,65	4,35	19,59	-0,45		
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	-4,44	17,78	-1,90	8,26	29,28	17,25	5,01	10,55
SELIC - BENCHMARK	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80		
BRANCO 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		
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-2,22	3,78	-6,67	13,72	-3,11	-15,43	9,13	19,24
IPCA + 5,00% AO ANO - BENCHMARK	0,65	7,34	1,85	3,88	10,44	24,28		
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11		0,21				0,33	0,70







CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	94.418.194,18
ITAU UNIBANCO S.A.	38.016.928,51
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	27.954.645,55
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	18.140.838,92
TRIGONO CAPITAL LTDA.	16.479.441,38
SANTANDER BRASIL GESTÃO DE REC...	12.817.631,30
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	10.181.763,53
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSO...	3.518.635,99
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	2.544.953,34
ICATU VANGUARDA GESTÃO DE RECU...	1.998.591,98
FINACAP INVESTIMENTOS LTDA	1.962.529,99
BANCO J. SAFRA S.A	1.660.609,63
BAYES CAPITAL MANAGEMENT INVES...	996.714,07
ITAÚ DTVM S.A.	106.265,04



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	94.418.194,18
ITAU UNIBANCO S.A.	38.123.193,55
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	27.954.645,55
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	18.658.235,56
BANCO BRADESCO S.A.	18.140.838,92
BANCO DAYCOVAL S.A.	16.479.441,38
BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.	12.817.631,30
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	4.205.562,97

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	204.164.055,70	2.896.059,86	1.854.870,57	209.127.321,75	3.922.076,76	3.922.076,76	1,91% ▲	1,91%	0,95%	0,95%	201,05%	3,19%
Fevereiro	209.127.321,75	51.692.355,06	50.706.236,85	208.420.955,73	-1.692.484,23	2.229.592,53	-0,81% ▼	1,09%	1,19%	2,15%	50,70%	2,67%
Março	208.420.955,73	5.374.516,61	4.985.574,82	210.024.038,01	1.214.140,49	3.443.733,02	0,58% ▲	1,68%	1,15%	3,33%	50,45%	2,87%
Abril	210.024.038,01	1.566.970,07	1.066.830,37	212.449.548,95	1.925.371,24	5.369.104,26	0,91% ▲	2,61%	0,96%	4,32%	60,42%	2,72%
Mai	212.449.548,95	29.345.671,08	28.707.041,36	218.247.253,35	5.159.074,68	10.528.178,94	2,42% ▲	5,09%	0,65%	5,00%	101,80%	2,61%
Junho	218.247.253,35	8.496.224,40	7.895.653,57	225.037.498,61	6.189.674,43	16.717.853,37	2,83% ▲	8,06%	0,32%	5,34%	150,94%	2,34%
Julho	225.037.498,61	17.205.374,34	16.751.247,83	228.915.956,06	3.424.330,94	20.142.184,31	1,52% ▲	9,71%	0,52%	5,89%	164,86%	2,30%
Agosto	228.915.956,06	14.172.752,31	15.469.073,66	227.067.962,35	-551.672,36	19.590.511,95	-0,24% ▼	9,44%	0,67%	6,60%	143,03%	2,66%
Setembro	227.067.962,35	4.197.338,35	976.291,67	230.797.743,41	508.734,38	20.099.246,33	0,22% ▲	9,68%	0,64%	7,29%	132,78%	2,65%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	3.443.733,02	1,68%	3,33%
2º Trim	13.274.120,35	6,28%	1,94%
1º Sem	16.717.853,37	8,06%	5,34%
3º Trim	3.381.392,96	1,50%	1,85%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

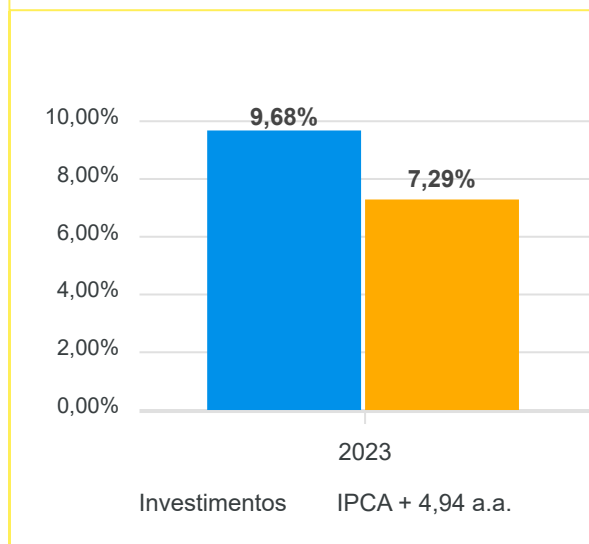


Gráfico Risco x Retorno

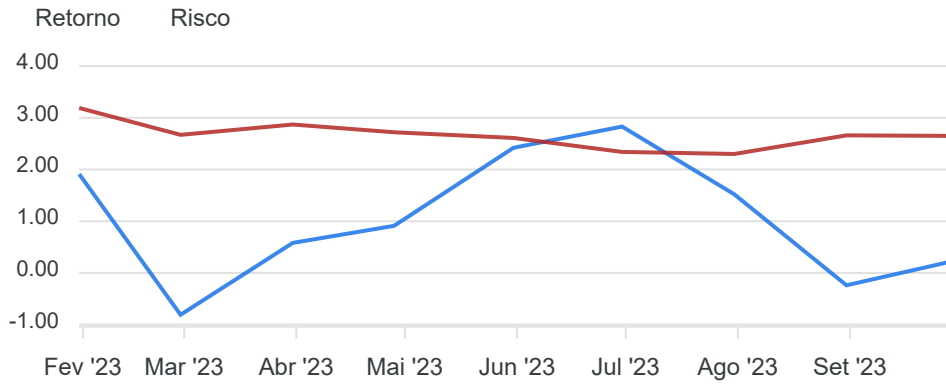
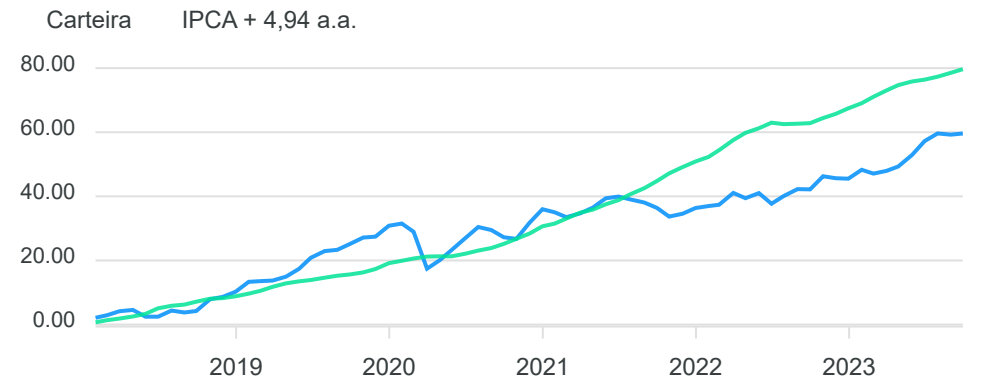
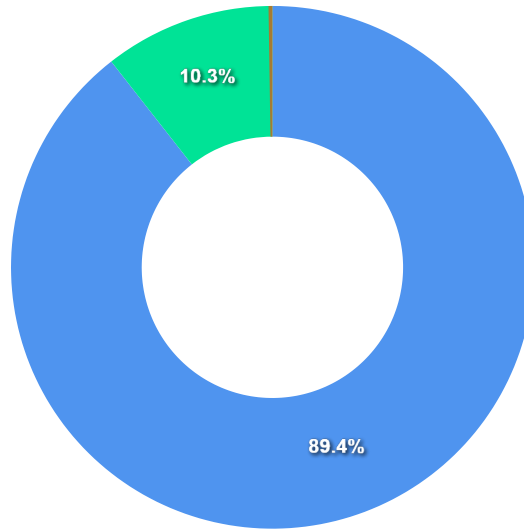


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 29/09/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	206.397.699,62	89,43
Até D+180	23.851.566,33	10,33
Até D+360	548.477,46	0,24
Até D+720	0,00	0,00
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	824.771,58	0,00	0,00	826.517,63	1.746,05	0,21% ▲	0,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.318.382,75	0,00	0,00	3.286.231,02	-32.151,73	-0,97% ▼	2,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.850.083,68	0,00	0,00	2.877.728,98	27.645,30	0,97% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.006.483,96	0,00	0,00	10.117.214,14	110.730,18	1,11% ▲	0,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.986.201,44	600.000,00	0,00	2.557.762,12	-28.439,32	-1,10% ▼	2,57%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.519.033,54	0,00	0,00	14.671.395,72	152.362,18	1,05% ▲	0,03%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	542.525,38	0,00	0,00	548.477,46	5.952,08	1,10% ▲	0,33%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.593.227,47	0,00	0,00	16.776.773,75	183.546,28	1,11% ▲	0,33%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.798.503,33	0,00	0,00	3.815.682,52	17.179,19	0,45% ▲	0,54%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.667.461,11	0,00	0,00	3.682.271,42	14.810,31	0,40% ▲	0,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	173.729,15	0,00	23.740,12	150.635,54	646,51	0,37% ▲	0,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.776.860,86	0,00	0,00	13.792.278,86	15.418,00	0,11% ▲	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.988.239,98	1.110.250,60	656.585,50	26.184.023,80	-257.881,28	-0,95% ▼	2,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.812.750,16	487.087,75	295.966,05	5.047.379,31	43.507,45	0,82% ▲	0,07%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.612.049,68	0,00	0,00	4.618.784,62	6.734,94	0,15% ▲	1,12%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	10.733.961,57	0,00	0,00	10.843.286,13	109.324,56	1,02% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	718.672,15	0,00	0,00	725.525,21	6.853,06	0,95% ▲	0,03%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	9.690.181,43	0,00	0,00	9.567.918,92	-122.262,51	-1,26% ▼	2,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.712.094,38	0,00	0,00	11.835.273,54	123.179,16	1,05% ▲	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	6.857.575,44	0,00	0,00	6.886.241,02	28.665,58	0,42% ▲	0,59%
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.643.207,85	0,00	0,00	1.660.609,63	17.401,78	1,06% ▲	0,06%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.410.627,87	0,00	0,00	10.516.811,55	106.183,68	1,02% ▲	0,01%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.297.651,43	0,00	0,00	2.300.819,75	3.168,32	0,14% ▲	1,13%
	161.534.276,19	2.197.338,35	976.291,67	163.289.642,64	534.319,77	0,33%	0,91%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	994.360,13	0,00	0,00	996.714,07	2.353,94	0,24% ▲	6,49%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.359.647,52	0,00	0,00	5.373.532,97	13.885,45	0,26% ▲	7,72%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2.901.774,98	0,00	0,00	2.893.362,43	-8.412,55	-0,29% ▼	6,89%
BRANCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	921.080,01	0,00	0,00	911.681,08	-9.398,93	-1,02% ▼	8,75%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.016.134,37	0,00	0,00	1.014.903,99	-1.230,38	-0,12% ▼	8,45%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	9.616,49	0,00	0,00	9.636,66	20,17	0,21% ▲	6,87%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	106.191,07	0,00	0,00	106.265,04	73,97	0,07% ▲	7,48%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	419.485,40	0,00	0,00	410.168,61	-9.316,79	-2,22% ▼	9,13%
OCCAM FIC AÇÕES	3.491.219,46	0,00	0,00	3.518.635,99	27.416,53	0,79% ▲	7,05%
SAFRA SMALL CAP PB FIC AÇÕES	2.654.010,38	0,00	0,00	2.544.953,34	-109.057,04	-4,11% ▼	8,43%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	10.298.087,42	0,00	0,00	10.181.763,53	-116.323,89	-1,13% ▼	7,28%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.555.935,10	0,00	0,00	10.057.424,28	501.489,18	5,25% ▲	9,54%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.233.784,70	0,00	0,00	6.422.017,10	188.232,40	3,02% ▲	9,80%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.962.529,99	-37.470,01	-1,87% ▼	7,48%
-	43.961.327,03	2.000.000,00	0,00	46.403.589,08	442.262,05	0,96%	8,25%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	5.510.763,46	0,00	0,00	5.557.631,13	46.867,67	0,85% ▲	1,95%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.114.578,03	0,00	0,00	1.124.116,45	9.538,42	0,86% ▲	0,12%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	531.623,24	0,00	0,00	536.423,99	4.800,75	0,90% ▲	2,15%
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	2.000.000,00	0,00	0,00	1.998.591,98	-1.408,02	-0,07% ▼	3,11%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	9.740.325,67	0,00	0,00	9.307.689,76	-432.635,91	-4,44% ▼	5,01%
-	18.897.290,40	0,00	0,00	18.524.453,31	-372.837,09	-1,97%	3,51%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.757.202,36	0,00	0,00	1.692.951,83	-64.250,53	-3,66% ▼	5,71%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	917.866,37	0,00	0,00	887.106,55	-30.759,82	-3,35% ▼	6,92%
	2.675.068,73	0,00	0,00	2.580.058,38	-95.010,35	-3,55%	3,75%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.808.340,69	0,00	3.000.000,00	826.517,63	18.176,94	0,48% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	3.294.638,82	0,00	3.286.231,02	-8.407,80	-0,26% ▼
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.787.861,09	0,00	0,00	2.877.728,98	89.867,89	3,22% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.101.297,94	0,00	294.638,82	10.117.214,14	310.555,02	3,07% ▲
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	2.600.000,00	0,00	2.557.762,12	-42.237,88	-1,62% ▼
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.169.710,58	0,00	0,00	14.671.395,72	501.685,14	3,54% ▲
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	545.983,36	0,00	14.166,53	548.477,46	16.660,63	3,05% ▲
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.742.175,11	0,00	480.510,13	16.776.773,75	515.108,77	3,08% ▲
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.737.837,00	0,00	0,00	3.815.682,52	77.845,52	2,08% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.612.216,85	0,00	0,00	3.682.271,42	70.054,57	1,94% ▲
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.588.394,16	417.826,85	5.870.967,90	150.635,54	15.382,43	0,26% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.565.995,94	0,00	0,00	13.792.278,86	226.282,92	1,67% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.527.769,94	13.189.146,57	5.369.452,74	26.184.023,80	-163.439,97	-0,52% ▼
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.991.736,59	771.473,05	864.497,33	5.047.379,31	148.667,00	2,58% ▲
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.538.484,62	0,00	0,00	4.618.784,62	80.300,00	1,77% ▲
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	10.484.594,39	0,00	0,00	10.843.286,13	358.691,74	3,42% ▲
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	703.301,38	0,00	0,00	725.525,21	22.223,83	3,16% ▲
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	4.141.500,34	5.487.666,01	0,00	9.567.918,92	-61.247,43	-0,64% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	5.485.939,33	0,00	5.487.666,01	0,00	1.726,68	0,03% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.430.289,77	0,00	0,00	11.835.273,54	404.983,77	3,54% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	6.746.408,59	0,00	0,00	6.886.241,02	139.832,43	2,07% ▲
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	1.614.713,70	0,00	1.660.609,63	45.895,93	2,84% ▲
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.159.009,17	0,00	0,00	10.516.811,55	357.802,38	3,52% ▲
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.261.173,19	0,00	0,00	2.300.819,75	39.646,56	1,75% ▲
	154.130.020,03	27.375.465,00	21.381.899,46	163.289.642,64	3.166.057,07	1,98%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	996.714,07	-3.285,93	-0,33% ▼
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.480.899,42	0,00	0,00	5.373.532,97	-107.366,45	-1,96% ▼
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3.030.371,42	0,00	0,00	2.893.362,43	-137.008,99	-4,52% ▼
BRDESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	4.029.395,16	0,00	3.000.000,00	911.681,08	-117.714,08	-2,92% ▼
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.032.334,58	0,00	0,00	1.014.903,99	-17.430,59	-1,69% ▼
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.962.529,99	-37.470,01	-1,87% ▼
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	9.639,17	0,00	0,00	9.636,66	-2,51	-0,03% ▼
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.099.755,12	0,00	2.000.000,00	106.265,04	6.509,92	0,31% ▲
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	3.162.370,96	0,00	2.700.000,00	410.168,61	-52.202,35	-1,65% ▼
OCCAM FIC AÇÕES	3.601.972,33	0,00	0,00	3.518.635,99	-83.336,34	-2,31% ▼
SAFRA SMALL CAP PB FIC AÇÕES	0,00	2.700.000,00	0,00	2.544.953,34	-155.046,66	-5,74% ▼
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	10.525.802,06	0,00	0,00	10.181.763,53	-344.038,53	-3,27% ▼
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.243.283,16	0,00	0,00	10.057.424,28	814.141,12	8,81% ▲
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.937.713,06	0,00	0,00	6.422.017,10	484.304,04	8,16% ▲
	48.153.536,44	5.700.000,00	7.700.000,00	46.403.589,08	250.052,64	0,52%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	5.452.026,31	0,00	0,00	5.557.631,13	105.604,82	1,94% ▲
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.093.758,46	0,00	0,00	1.124.116,45	30.357,99	2,78% ▲
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.508.337,79	0,00	2.000.000,00	536.423,99	28.086,20	1,12% ▲
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	1.998.591,98	-1.408,02	-0,07% ▼
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	9.488.160,95	0,00	0,00	9.307.689,76	-180.471,19	-1,90% ▼
	18.542.283,51	2.000.000,00	2.000.000,00	18.524.453,31	-17.830,20	-0,10%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.729.853,91	0,00	0,00	1.692.951,83	-36.902,08	-2,13% ▼
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	384.385,76	500.000,00	0,00	887.106,55	2.720,79	0,31% ▲
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.097.418,96	0,00	2.114.713,70	0,00	17.294,74	0,82% ▲
	4.211.658,63	500.000,00	2.114.713,70	2.580.058,38	-16.886,55	-0,40%

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

