

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
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	25.403.073,50	9,29%	247.573.985,11	10,26%	7º I b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.291.633,58	6,69%	6.050.581.610,41	0,30%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.527.562,99	2,39%	5.453.684.801,95	0,12%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.326.527,43	1,58%	1.516.152.288,42	0,29%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.636.717,43	13,40%	5.367.605.963,99	0,68%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.698.740,36	2,08%	2.459.230.011,04	0,23%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	158.275,66	0,06%	3.520.695.315,59	0,00%	7º I b
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	13.627.402,00	4,98%	4.578.244.933,29	0,30%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.493.522,62	0,55%	488.601.272,15	0,31%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	22.575.704,40	8,26%	8.162.684.334,70	0,28%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.413.387,92	0,88%	1.488.811.938,74	0,16%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.895.509,50	4,72%	5.222.821.325,49	0,25%	7º I b
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	2.377.784,31	0,87%	39.295.223.216,04	0,01%	7º I b
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	9.286.699,45	3,40%	164.039.148,18	5,66%	7º III a
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.783.977,11	1,02%	2.855.154.715,94	0,10%	7º III a
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	1.019.615,27	0,37%	229.043.752,42	0,45%	7º III a
LF BRADESCO 05/06/2025 IPCA + 6,38%	8.459.067,44	3,09%	0,00		7º IV
LF DAYCOVAL 06/06/2025 IPCA + 7,12%	13.100.467,21	4,79%	0,00		7º IV
LF SANTANDER 05/06/2025 IPCA + 6,45%	5.116.509,77	1,87%	0,00		7º IV
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.388.540,46	1,97%	2.528.521.161,64	0,21%	7º V b
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.626.063,94	0,59%	1.247.653.218,33	0,13%	8º I
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.857.242,45	2,87%	1.378.543.679,32	0,57%	8º I
BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES	5.409.345,81	1,98%	233.474.809,22	2,32%	8º I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.966.277,12	1,09%	762.055.294,68	0,39%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.799.436,21	1,39%	628.673.074,03	0,60%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6.604.662,73	2,42%	416.879.369,35	1,58%	8º I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	19.124.580,23	7,00%	936.050.590,14	2,04%	8º I

Investimentos

\$ 273.370.289,34

Disponibilidades Financeiras

\$ 15.599.406,00

Total Carteira

\$ 288.969.695,34

Governança (Pró Gestão)



Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
OCCAM FIC AÇÕES	923.592,92	0,34%	809.855.751,72	0,11%	8º I
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.163.193,80	0,79%	169.666.768,08	1,27%	8º I
QLZ MOS FI AÇÕES	3.340.882,95	1,22%	65.644.365,78	5,09%	8º I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	850.592,06	0,31%	314.743.218,24	0,27%	8º I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	10.000.791,96	3,66%	1.889.506.919,93	0,53%	8º I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.203.700,60	0,81%	226.985.021,88	0,97%	10º I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	2.150.210,32	0,79%	135.602.128,57	1,59%	10º I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	788.448,17	0,29%	165.157.910,12	0,48%	10º I
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.796.777,03	1,02%	45.643.401,32	6,13%	10º I
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	2.141.435,83	0,78%	743.656.002,66	0,29%	10º I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.042.336,80	0,38%	128.518.985,60	0,81%	11º

Investimentos

\$ 273.370.289,34

Disponibilidades Financeiras

\$ 15.599.406,00

Total Carteira

\$ 288.969.695,34

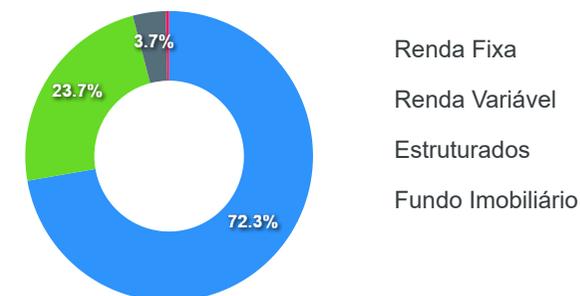
Governança (Pró Gestão)


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7° I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	55,76%	152.425.841,70 44,24%
7° III a - FI Referenciados RF	60,00%	4,79%	13.090.291,83 55,21%
7° IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de...	20,00%	9,76%	26.676.044,42 10,24%
7° V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	1,97%	5.388.540,46 3,03%
8° I - Fundos de Ações	30,00%	23,66%	64.666.662,18 6,34%
10° I - Fundos Multimercados	10,00%	3,69%	10.080.571,95 6,31%
11° - Fundos Imobiliários	5,00%	0,38%	1.042.336,80 4,62%

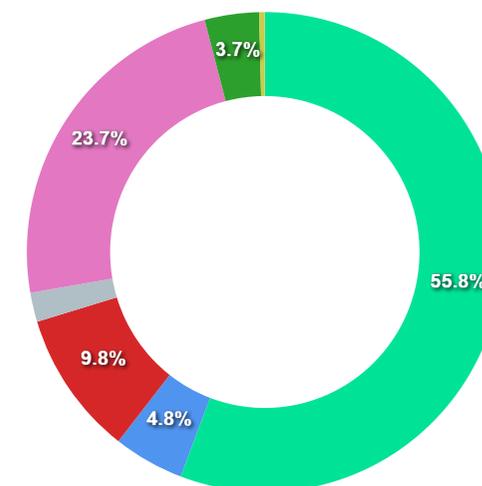
Governança (Pró Gestão)

Não possui

Segmentos



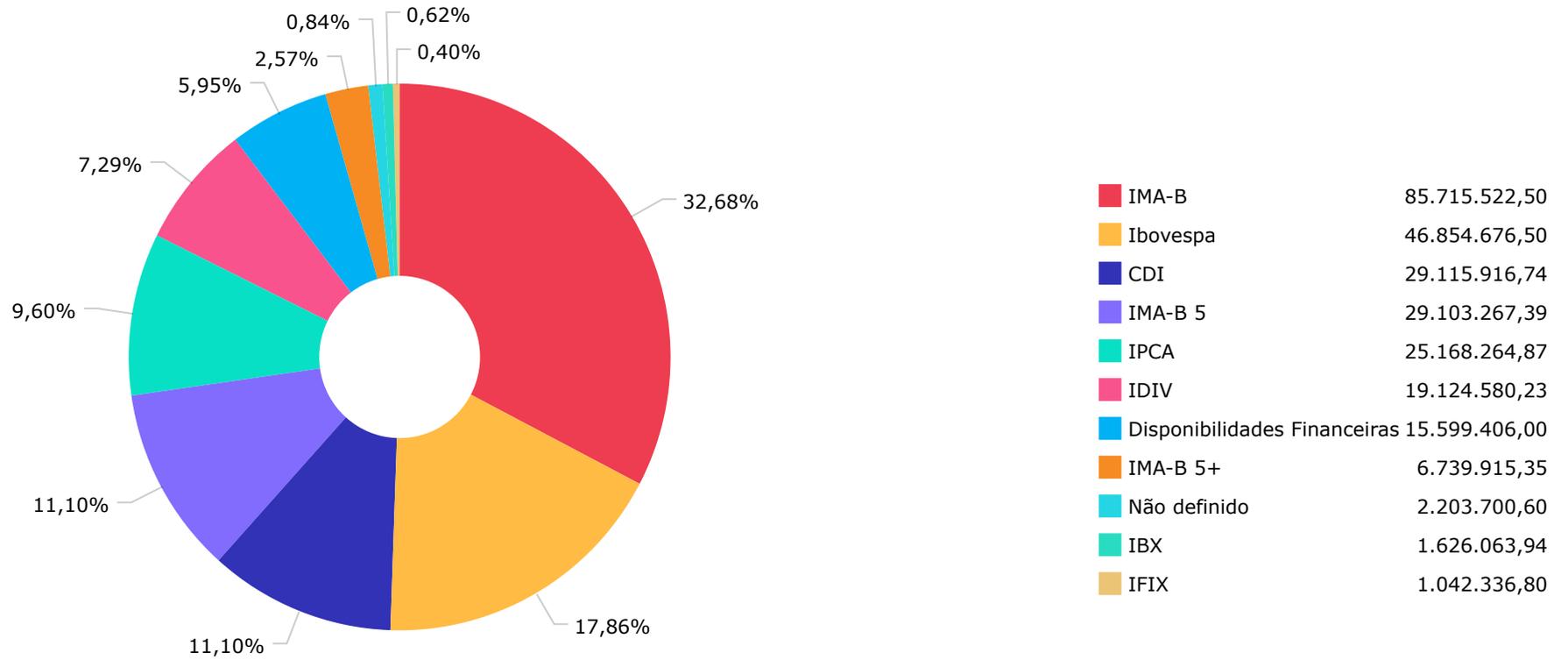
Artigos

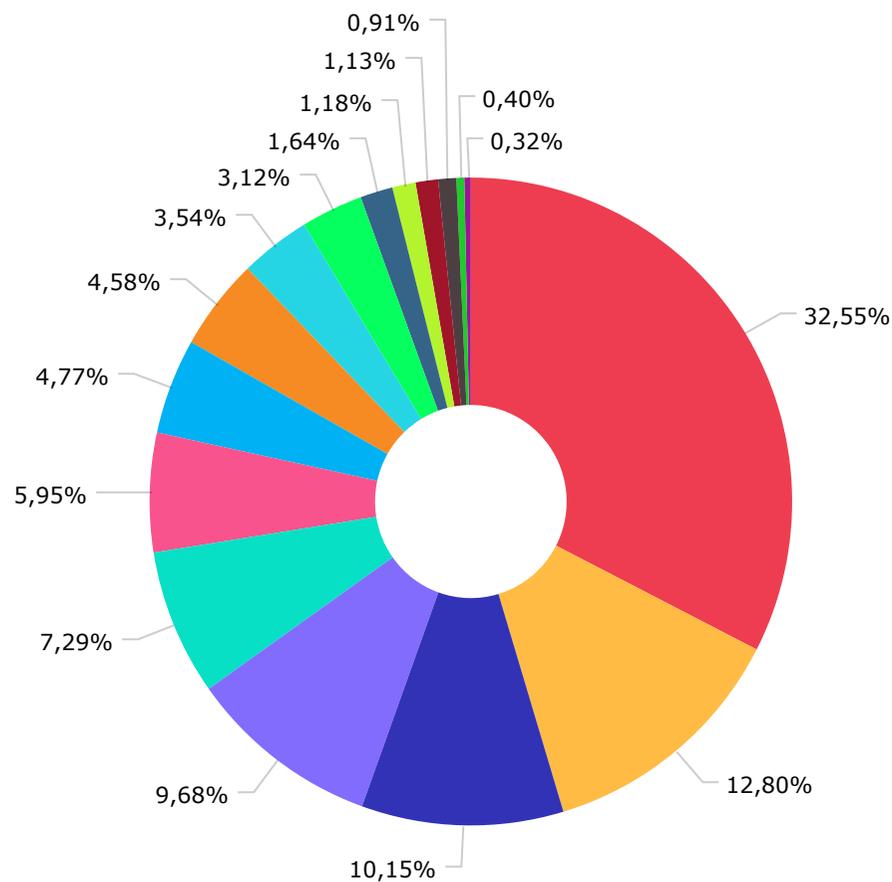


Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	5,00%	100,00%	273.370.289,34	8° I - Fundos de Ações	23,66%	0,00%	22,00%	30,00%	17.344.424,62
7° I b - FI 100% Títulos TN	55,76%	0,00%	42,00%	100,00%	120.944.447,64	9° III - Ações - BDR Nível I	0,00%	0,00%	8,00%	10,00%	27.337.028,93
7° III a - FI Referenciados RF	4,79%	0,00%	12,00%	60,00%	150.931.881,77	10° I - Fundos Multimercados	3,69%	0,00%	6,00%	10,00%	17.256.456,98
7° IV - Ativos Financeiros de ...	9,76%	0,00%	1,00%	20,00%	27.998.013,45	11° - Fundos Imobiliários	0,38%	0,00%	1,00%	5,00%	12.626.177,67
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	13.668.514,47						
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	1,97%	0,00%	1,00%	5,00%	8.279.974,01						
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	13.668.514,47						

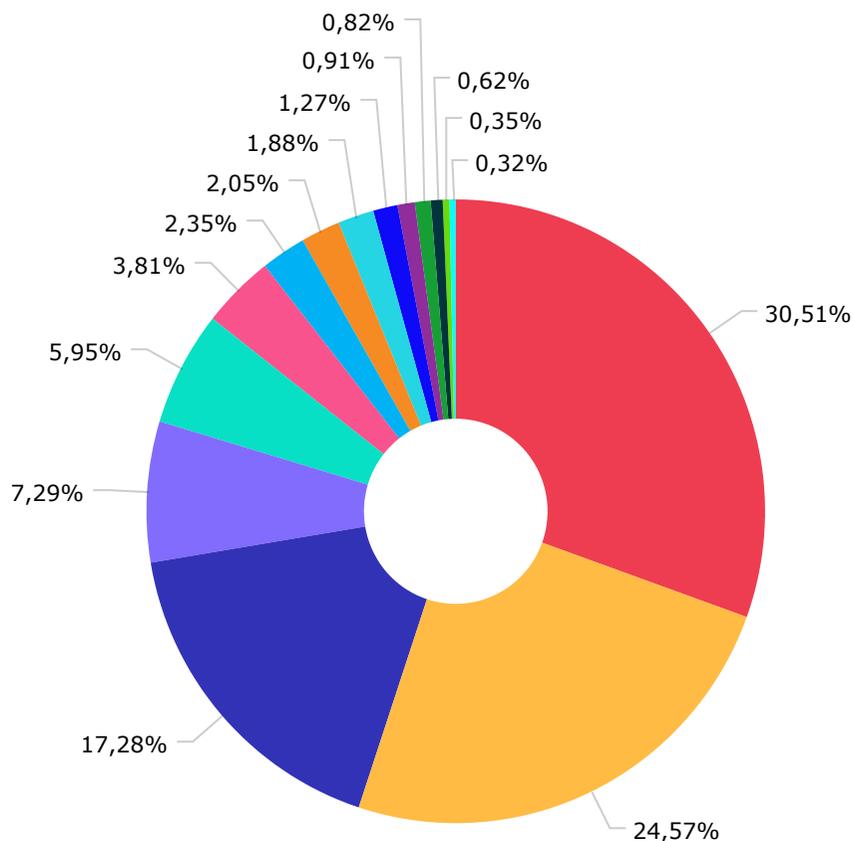
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,31	9,82	2,28	6,29	10,76		0,67	1,42
CDI - BENCHMARK								
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,06	10,41	3,38	6,74	14,17	27,92	0,06	0,13
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,97	9,89	3,21	6,45	13,38	25,76	0,01	0,02
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,96	9,74	3,16	6,34	13,18	25,23	0,01	0,01
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,01	8,97	2,96	6,00	11,95	25,57	0,13	0,27
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,00	7,71	3,42	6,52	11,21	24,07	0,02	0,03
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	-3,73	20,68	-0,31	10,84			3,99	8,40
IBOVESPA - BENCHMARK								
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	7,65	39,29	11,58	45,55	32,33	58,35	8,10	17,05
QLZ MOS FI AÇÕES	-3,46	22,91	-4,46	32,51	19,35	14,49	9,75	20,52
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,84	9,30	-0,67	13,09	9,61	28,84	7,54	15,89
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,38	5,12	-0,38	6,24	6,42		3,63	7,64
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	0,67	5,94	-1,29	14,07	5,77	4,94	7,41	15,60
BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES	0,61	5,73	-1,52	13,95	5,36	3,53	7,49	15,77
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	0,90	5,40	-1,05	14,24	4,22	1,06	7,77	16,37
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,01	6,08	-1,83	14,98	1,58	-6,59	7,55	15,91
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,32	2,38	1,10	-0,10	0,65		1,75	3,69
OCCAM FIC AÇÕES	0,79	2,14	-2,31	9,30	0,55	2,27	7,05	14,84
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,62	2,68	-3,71	10,74	-1,33	-20,97	8,07	17,00
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	0,73	-0,47	-2,29	11,85	-2,06	-7,98	7,14	15,05
IBX - BENCHMARK								
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,06	5,86	-3,41	11,98	2,07	-11,33	9,04	19,05

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
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
IMA-B - BENCHMARK	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09		
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,04	10,52	-0,74	6,40	10,79	16,86	2,65	5,57
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
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	-1,09	10,28	-0,89	7,05	10,44	18,45	2,76	5,81
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		
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
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,11	8,75	1,65	4,25	11,41	21,41	0,99	2,08
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,86	11,75	-2,38	7,97	9,75	15,00	3,94	8,30
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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88	11,72	2,73	7,91	13,59	23,82	0,14	0,30
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10	8,82	3,09	4,57	11,76		0,33	0,70
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,21		2,55				2,11	4,45
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11		3,12				0,33	0,70
IFIX - BENCHMARK	0,20	12,28	2,03	16,60	7,64	18,54		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-2,90	29,46	3,66	30,48	16,63	13,25	4,56	9,60

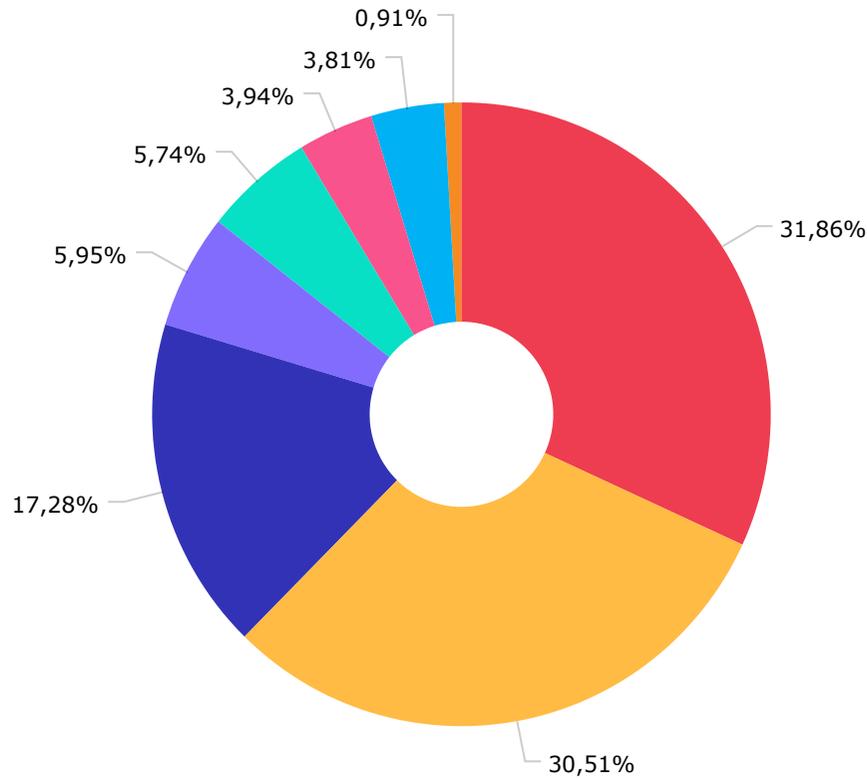




Renda Fixa Indexados	85.375.409,67
Renda Fixa Duração Livre Soberano	33.570.833,86
Ações Livre	26.624.417,51
Renda Fixa Duração Alta Soberano	25.403.073,50
Ações Dividendos	19.124.580,23
Disponibilidades Financeiras	15.599.406,00
Não classificado	12.507.281,43
Ações Indexados	12.014.008,54
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	9.286.699,45
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	8.172.517,57
Multimercados Livre	4.291.646,15
Ações Valor/Crescimento	3.086.786,72
Ações Sustentabilidade/Governança	2.966.277,12
Renda Fixa Simples	2.377.784,31
FII TVM Gestão Ativa	1.042.336,80
Ações Índice Ativo	850.592,06



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	80.015.080,38
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	64.451.962,18
BANESTES DISTRIBUIDORA DE TÍTU...	45.330.992,51
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU...	19.124.580,23
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	15.599.406,00
TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA	10.000.791,96
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	6.161.974,36
BANCO J. SAFRA S.A	5.388.540,46
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	4.938.212,86
MOS GESTÃO DE INVESTIMENTOS LT...	3.340.882,95
ITAU UNIBANCO S.A.	2.377.784,31
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	2.163.193,80
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	1.626.063,94
OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSO...	923.592,92
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	850.592,06



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	83.576.542,41
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	80.015.080,38
BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO...	45.330.992,51
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	15.599.406,00
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	15.066.300,03
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	10.326.753,32
BANCO DAYCOVAL S.A.	10.000.791,96
ITAU UNIBANCO S.A.	2.377.784,31

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	254.077.722,72	11.212.023,84	10.163.473,25	258.220.625,09	3.094.351,78	3.094.351,78	1,21% ▲	1,21%	0,98%	0,98%	123,47%	4,17%
Fevereiro	258.220.625,09	41.142.662,54	40.095.713,33	258.115.668,06	-1.151.906,24	1.942.445,54	-0,44% ▼	0,76%	1,21%	2,19%	34,70%	3,27%
Março	258.115.668,06	9.144.212,29	8.010.356,80	261.637.628,19	2.388.104,64	4.330.550,18	0,92% ▲	1,69%	1,18%	3,40%	49,71%	2,79%
Abril	261.637.628,19	2.000.000,00	1.026.156,80	265.942.860,18	3.331.388,79	7.661.938,97	1,27% ▲	2,98%	0,97%	4,40%	67,73%	2,75%
Mai	265.942.860,18	43.163.360,97	41.966.597,57	272.802.871,64	5.663.248,06	13.325.187,03	2,12% ▲	5,16%	0,67%	5,11%	100,98%	2,51%
Junho	272.802.871,64	64.950.000,00	63.830.258,96	282.259.627,90	8.337.015,22	21.662.202,25	3,04% ▲	8,37%	0,34%	5,47%	153,02%	2,99%
Julho	282.259.627,90	11.654.406,32	10.522.458,28	287.639.501,45	4.247.925,51	25.910.127,76	1,50% ▲	9,99%	0,54%	6,04%	165,40%	2,71%
Agosto	287.639.501,45	3.891.167,92	3.091.028,46	286.391.756,59	-2.047.884,32	23.862.243,44	-0,71% ▼	9,21%	0,69%	6,78%	135,84%	2,76%
Setembro	286.391.756,59	4.109.073,51	16.883.096,02	273.370.289,34	-247.444,74	23.614.798,70	-0,09% ▼	9,11%	0,66%	7,49%	121,63%	2,90%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	4.330.550,18	1,69%	3,40%
2º Trim	17.331.652,07	6,56%	2,00%
1º Sem	21.662.202,25	8,37%	5,47%
3º Trim	1.952.596,45	0,69%	1,91%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado



Gráfico Risco x Retorno

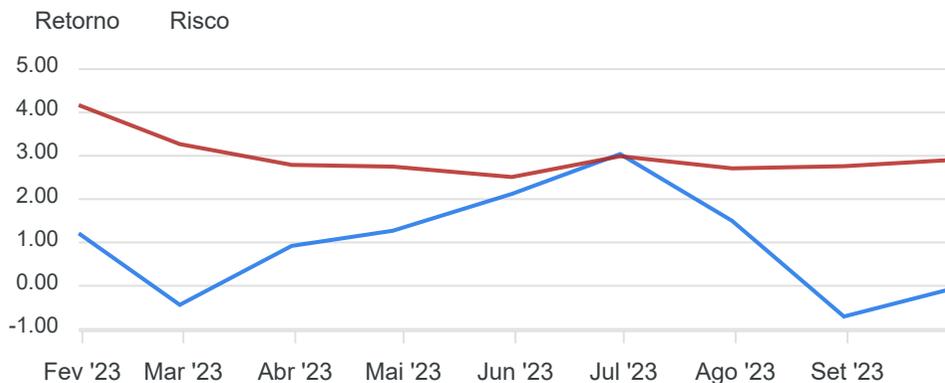
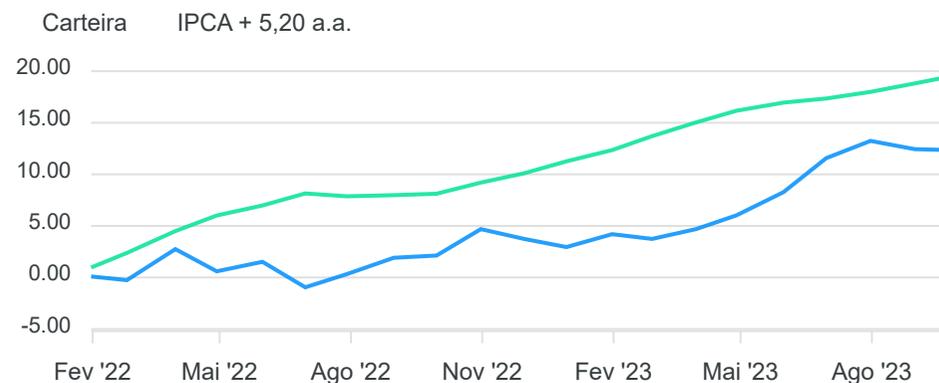
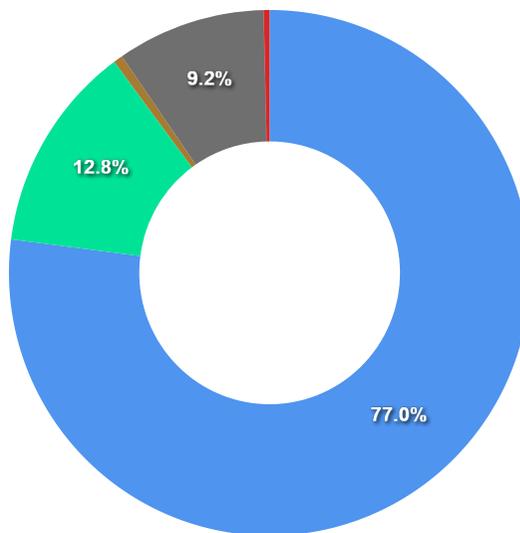


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 29/09/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	222.616.901,20	81,43
Até D+180	36.982.614,64	13,53
Até D+360	1.651.798,28	0,60
Até D+720	26.676.044,42	9,76
Até D+1800	0,00	0,00
Até D+3600	0,00	0,00
Acima D+3600	0,00	0,00
Indeterminado	1.042.336,80	0,38



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	25.669.026,69	0,00	0,00	25.403.073,50	-265.953,19	-1,04% ▼	2,65%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	9.389.255,18	0,00	0,00	9.286.699,45	-102.555,73	-1,09% ▼	2,76%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	942.334,91	2.100.000,00	280.000,00	2.783.977,11	21.642,20	0,71% ▲	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.138.986,75	2.009.073,51	0,00	18.291.633,58	143.573,32	0,79% ▲	0,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.520.315,56	0,00	0,00	6.527.562,99	7.247,43	0,11% ▲	0,99%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.412.823,85	0,00	0,00	4.326.527,43	-86.296,42	-1,96% ▼	4,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.995.162,71	0,00	0,00	36.636.717,43	-358.445,28	-0,97% ▼	2,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.636.369,19	0,00	0,00	5.698.740,36	62.371,17	1,11% ▲	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	156.556,15	0,00	0,00	158.275,66	1.719,51	1,10% ▲	0,33%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	13.498.329,36	0,00	0,00	13.627.402,00	129.072,64	0,96% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.477.314,92	0,00	0,00	1.493.522,62	16.207,70	1,10% ▲	0,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	22.550.467,66	0,00	0,00	22.575.704,40	25.236,74	0,11% ▲	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.459.134,78	0,00	0,00	2.413.387,92	-45.746,86	-1,86% ▼	3,94%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.020.120,93	0,00	0,00	12.895.509,50	-124.611,43	-0,96% ▼	2,51%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	2.354.825,18	0,00	0,00	2.377.784,31	22.959,13	0,97% ▲	0,01%
LF BRADESCO 05/06/2025 IPCA + 6,38%	8.399.811,01	0,00	0,00	8.459.067,44	59.256,43	0,71% ▲	-
LF DAYCOVAL 06/06/2025 IPCA + 7,12%	13.003.524,21	0,00	0,00	13.100.467,21	96.943,00	0,75% ▲	-
LF SANTANDER 05/06/2025 IPCA + 6,45%	5.085.090,34	0,00	0,00	5.116.509,77	31.419,43	0,62% ▲	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	1.017.492,87	0,00	0,00	1.019.615,27	2.122,40	0,21% ▲	2,11%
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.332.073,15	0,00	0,00	5.388.540,46	56.467,31	1,06% ▲	0,06%
	194.059.015,40	4.109.073,51	280.000,00	197.580.718,41	-307.370,50	-0,16%	1,42%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.643.411,21	0,00	0,00	1.626.063,94	-17.347,27	-1,06% ▼	9,04%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.808.571,55	0,00	0,00	7.857.242,45	48.670,90	0,62% ▲	8,07%
BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES	5.376.444,98	0,00	0,00	5.409.345,81	32.900,83	0,61% ▲	7,49%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.939.754,68	0,00	0,00	2.966.277,12	26.522,44	0,90% ▲	7,77%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.811.565,60	0,00	0,00	3.799.436,21	-12.129,39	-0,32% ▼	7,55%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6.560.709,23	0,00	0,00	6.604.662,73	43.953,50	0,67% ▲	7,41%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	19.022.042,67	0,00	0,00	19.124.580,23	102.537,56	0,54% ▲	6,43%
OCCAM FIC AÇÕES	916.396,46	0,00	0,00	923.592,92	7.196,46	0,79% ▲	7,05%
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.145.235,70	0,00	0,00	2.163.193,80	17.958,10	0,84% ▲	7,54%
QLZ MOS FI AÇÕES	3.460.794,42	0,00	0,00	3.340.882,95	-119.911,47	-3,46% ▼	9,75%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	844.418,73	0,00	0,00	850.592,06	6.173,33	0,73% ▲	7,14%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	9.289.670,95	0,00	0,00	10.000.791,96	711.121,01	7,65% ▲	8,10%
-	63.819.016,18	0,00	0,00	64.666.662,18	847.646,00	1,33%	7,50%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.196.969,54	0,00	0,00	2.203.700,60	6.731,06	0,31% ▲	0,67%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	2.142.105,55	0,00	0,00	2.150.210,32	8.104,77	0,38% ▲	3,63%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	785.956,77	0,00	0,00	788.448,17	2.491,40	0,32% ▲	1,75%
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.905.106,98	0,00	0,00	2.796.777,03	-108.329,95	-3,73% ▼	3,99%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	2.120.077,68	0,00	0,00	2.141.435,83	21.358,15	1,01% ▲	0,13%
-	10.150.216,52	0,00	0,00	10.080.571,95	-69.644,57	-0,69%	2,19%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.073.520,00	0,00	0,00	1.042.336,80	-31.183,20	-2,90% ▼	4,56%
-	1.073.520,00	0,00	0,00	1.042.336,80	-31.183,20	-2,90%	4,56%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.096.712,14	0,00	2.009.073,51	0,00	-87.638,63	-4,18% ▼	5,71%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	15.193.276,35	0,00	14.594.022,51	0,00	-599.253,84	-3,94% ▼	4,97%
	17.289.988,49	0,00	16.603.096,02	0,00	-686.892,47	-3,97%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	5.591.094,93	0,00	5.595.783,96	0,00	4.689,03	0,08% ▲
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.976.386,70	5.580.000,00	0,00	25.403.073,50	-153.313,20	-0,60% ▼
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	9.370.429,15	0,00	0,00	9.286.699,45	-83.729,70	-0,89% ▼
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.322.647,83	4.155.400,00	5.800.000,00	2.783.977,11	105.929,28	1,25% ▲
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.848.359,93	2.009.073,51	0,00	18.291.633,58	434.200,14	2,43% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.421.644,25	0,00	0,00	6.527.562,99	105.918,74	1,65% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.439.783,47	0,00	0,00	4.326.527,43	-113.256,04	-2,55% ▼
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.873.811,35	0,00	0,00	36.636.717,43	-237.093,92	-0,64% ▼
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.522.255,29	165.455,45	161.075,42	5.698.740,36	172.105,04	3,03% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	157.840,27	0,00	4.380,03	158.275,66	4.815,42	3,05% ▲
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	12.955.778,72	259.712,47	0,00	13.627.402,00	411.910,81	3,12% ▲
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.486.731,10	0,00	38.575,94	1.493.522,62	45.367,46	3,05% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	22.205.316,28	0,00	0,00	22.575.704,40	370.388,12	1,67% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.472.303,79	0,00	0,00	2.413.387,92	-58.915,87	-2,38% ▼
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.964.665,37	0,00	0,00	12.895.509,50	-69.155,87	-0,53% ▼
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	2.303.860,63	0,00	0,00	2.377.784,31	73.923,68	3,21% ▲
LF BRADESCO 05/06/2025 IPCA + 6,38%	8.303.069,26	0,00	0,00	8.459.067,44	155.998,18	1,88% ▲
LF DAYCOVAL 06/06/2025 IPCA + 7,12%	12.840.353,69	0,00	0,00	13.100.467,21	260.113,52	2,03% ▲
LF SANTANDER 05/06/2025 IPCA + 6,45%	5.022.373,19	0,00	0,00	5.116.509,77	94.136,58	1,87% ▲
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	994.304,01	0,00	0,00	1.019.615,27	25.311,26	2,55% ▲
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.212.152,24	0,00	0,00	5.388.540,46	176.388,22	3,38% ▲
	195.285.161,45	12.169.641,43	11.599.815,35	197.580.718,41	1.725.730,88	0,88%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.683.411,71	0,00	0,00	1.626.063,94	-57.347,77	-3,41% ▼
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.160.230,65	0,00	0,00	7.857.242,45	-302.988,20	-3,71% ▼
BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES	5.492.867,77	0,00	0,00	5.409.345,81	-83.521,96	-1,52% ▼
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.997.685,49	0,00	0,00	2.966.277,12	-31.408,37	-1,05% ▼
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.882.474,13	0,00	0,00	3.799.436,21	-83.037,92	-2,14% ▼
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6.690.884,93	0,00	0,00	6.604.662,73	-86.222,20	-1,29% ▼
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	260.633,27	0,00	259.712,47	0,00	-920,80	-0,35% ▼
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	19.175.406,07	0,00	0,00	19.124.580,23	-50.825,84	-0,27% ▼
OCCAM FIC AÇÕES	945.467,54	0,00	0,00	923.592,92	-21.874,62	-2,31% ▼
PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.177.692,50	0,00	0,00	2.163.193,80	-14.498,70	-0,67% ▼
QLZ MOS FI AÇÕES	0,00	3.519.006,32	0,00	3.340.882,95	-178.123,37	-5,06% ▼
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	2.019.006,32	0,00	19.006,32	0,95% ▲
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	870.533,32	0,00	0,00	850.592,06	-19.941,26	-2,29% ▼
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	7.130.826,24	1.966.000,00	0,00	10.000.791,96	903.965,72	9,94% ▲
	59.468.113,62	7.485.006,32	2.278.718,79	64.666.662,18	-7.738,97	-0,01%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.154.561,22	0,00	0,00	2.203.700,60	49.139,38	2,28% ▲
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	2.158.445,21	0,00	0,00	2.150.210,32	-8.234,89	-0,38% ▼
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	779.845,11	0,00	0,00	788.448,17	8.603,06	1,10% ▲
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.805.424,83	0,00	0,00	2.796.777,03	-8.647,80	-0,31% ▼
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	2.079.822,60	0,00	0,00	2.141.435,83	61.613,23	2,96% ▲
	9.978.098,97	0,00	0,00	10.080.571,95	102.472,98	1,03%

FUNDOS IMOBILIÁRIOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.005.530,40	0,00	14.952,60	1.042.336,80	51.759,00	5,15% ▲
	1.005.530,40	0,00	14.952,60	1.042.336,80	51.759,00	5,15%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.064.079,70	0,00	2.009.073,51	0,00	-55.006,19	-2,66% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	14.458.643,76	0,00	14.594.022,51	0,00	135.378,75	0,94% ▲
	16.522.723,46	0,00	16.603.096,02	0,00	80.372,56	0,49%

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

