

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 |
|---|---------------|------------|-------------------|--------|----------|
| BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 25.236.060,16 | 8,83% | 246.902.588,66 | 10,22% | 7º I b |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 18.447.262,57 | 6,46% | 6.082.622.569,66 | 0,30% | 7º I b |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 6.506.414,72 | 2,28% | 5.252.934.178,04 | 0,12% | 7º I b |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 4.283.776,36 | 1,50% | 1.473.904.353,82 | 0,29% | 7º I b |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 36.389.818,89 | 12,74% | 5.052.854.726,15 | 0,72% | 7º I b |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 10.979.627,18 | 3,84% | 2.503.461.334,36 | 0,44% | 7º I b |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 158.965,75 | 0,06% | 3.536.045.684,72 | 0,00% | 7º I b |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO | 35.768.814,51 | 12,52% | 4.513.745.754,41 | 0,79% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.500.029,81 | 0,52% | 490.730.076,47 | 0,31% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 22.503.078,51 | 7,88% | 7.787.487.970,57 | 0,29% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2.390.169,88 | 0,84% | 1.373.230.642,51 | 0,17% | 7º I b |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 12.809.823,49 | 4,48% | 5.036.600.197,80 | 0,25% | 7º I b |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES | 2.401.014,21 | 0,84% | 38.152.810.319,14 | 0,01% | 7º I b |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | 9.225.641,16 | 3,23% | 162.308.462,15 | 5,68% | 7º III a |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 3.958.104,58 | 1,39% | 2.855.852.769,66 | 0,14% | 7º III a |
| RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA | 1.022.200,93 | 0,36% | 229.624.594,02 | 0,45% | 7º III a |
| LF BRADESCO 05/06/2025 IPCA + 6,38% | 8.526.037,02 | 2,98% | 0,00 | | 7º IV |
| LF DAYCOVAL 06/06/2025 IPCA + 7,12% | 13.211.844,16 | 4,62% | 0,00 | | 7º IV |
| LF SANTANDER 05/06/2025 IPCA + 6,45% | 5.155.062,32 | 1,80% | 0,00 | | 7º IV |
| SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 5.445.720,04 | 1,91% | 3.157.249.576,42 | 0,17% | 7º V b |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 1.523.570,82 | 0,53% | 1.166.023.248,50 | 0,13% | 8º I |
| BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 7.555.705,74 | 2,64% | 1.324.423.181,38 | 0,57% | 8º I |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES | 2.859.061,62 | 1,00% | 730.788.793,77 | 0,39% | 8º I |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 1.928.533,23 | 0,67% | 586.219.451,06 | 0,33% | 8º I |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 18.548.428,91 | 6,49% | 892.057.729,49 | 2,08% | 8º I |
| OCCAM FIC AÇÕES | 901.741,88 | 0,32% | 743.764.993,45 | 0,12% | 8º I |
| PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES | 2.122.033,42 | 0,74% | 164.527.156,47 | 1,29% | 8º I |

Investimentos

\$ 285.724.379,96

Disponibilidades Financeiras

\$ 2.036.200,52

Total Carteira


\$ 287.760.580,48

Governança (Pró Gestão)


[🔗](#)

| Ativo | Saldo Atual | % Carteira | PL R\$ | % PL | Lei |
|---|--------------|------------|------------------|-------|-------|
| QLZ MOS FIAÇÕES | 3.118.080,85 | 1,09% | 61.175.562,19 | 5,10% | 8º I |
| SOMMA BRASIL FIAÇÕES | 822.877,58 | 0,29% | 291.247.396,01 | 0,28% | 8º I |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES | 9.396.607,34 | 3,29% | 1.772.465.430,71 | 0,53% | 8º I |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 2.216.521,92 | 0,78% | 228.305.649,03 | 0,97% | 10º I |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO | 2.125.993,74 | 0,74% | 134.074.924,65 | 1,59% | 10º I |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO | 793.229,43 | 0,28% | 166.159.454,23 | 0,48% | 10º I |
| SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 2.710.999,60 | 0,95% | 44.243.513,74 | 6,13% | 10º I |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO | 2.160.150,03 | 0,76% | 728.182.407,22 | 0,30% | 10º I |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 1.021.377,60 | 0,36% | 125.934.739,20 | 0,81% | 11º |


Investimentos

 285.724.379,96

Disponibilidades Financeiras

 2.036.200,52

Total Carteira

 287.760.580,48

Governança (Pró Gestão)

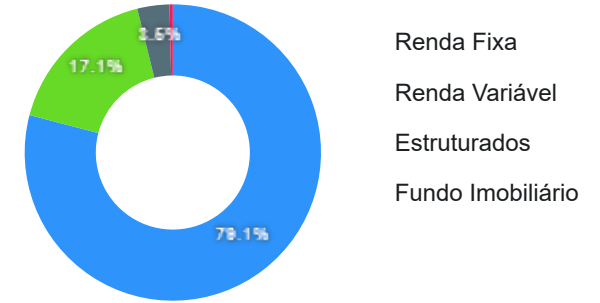


| Artigos | Limite (%) | Utilizado | Utilizado (%) | Livre |
|--|------------|-----------|----------------|-----------------------|
| 7° I b - FI 100% Títulos TN | 100,00% | 62,78% | 179.374.856,04 | 37,22% 106.349.523,92 |
| 7° III a - FI Referenciados RF | 60,00% | 4,97% | 14.205.946,67 | 55,03% 157.228.681,31 |
| 7° IV - Ativos Financeiros de RF - Emissão de... | 20,00% | 9,41% | 26.892.943,50 | 10,59% 30.251.932,49 |
| 7° V b - Fundos de RF - Crédito Privado | 5,00% | 1,91% | 5.445.720,04 | 3,09% 8.840.498,96 |
| 8° I - Fundos de Ações | 30,00% | 17,07% | 48.776.641,39 | 12,93% 36.940.672,60 |
| 10° I - Fundos Multimercados | 10,00% | 3,50% | 10.006.894,72 | 6,50% 18.565.543,28 |
| 11° - Fundos Imobiliários | 5,00% | 0,36% | 1.021.377,60 | 4,64% 13.264.841,40 |

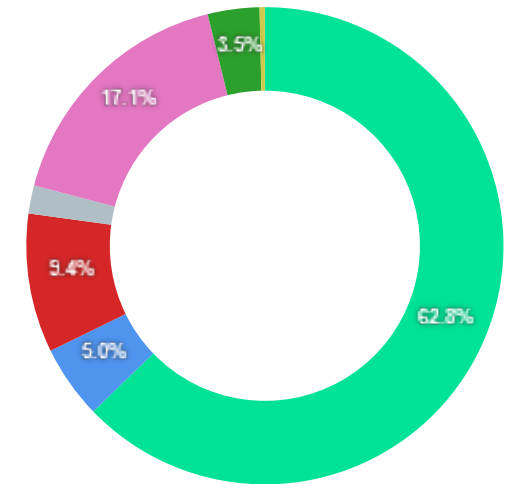
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



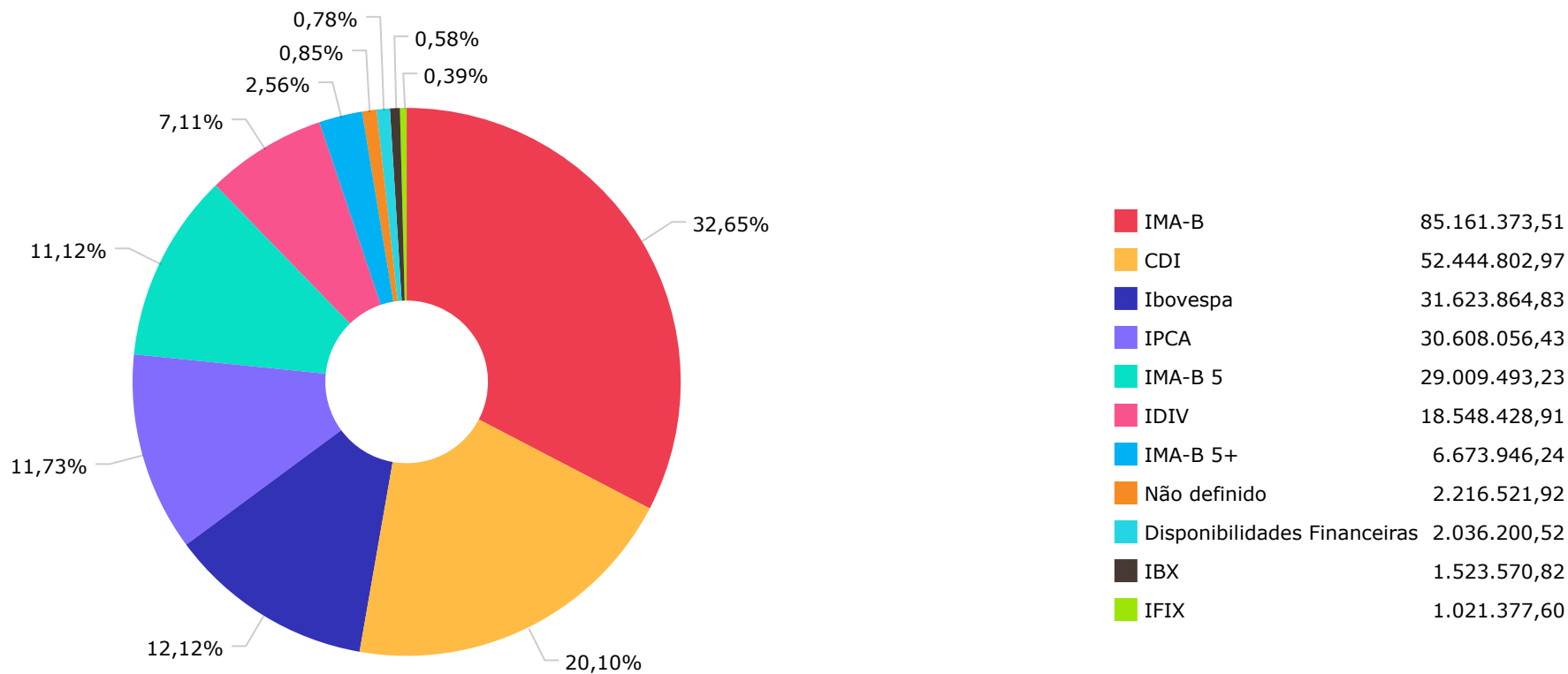
Artigos

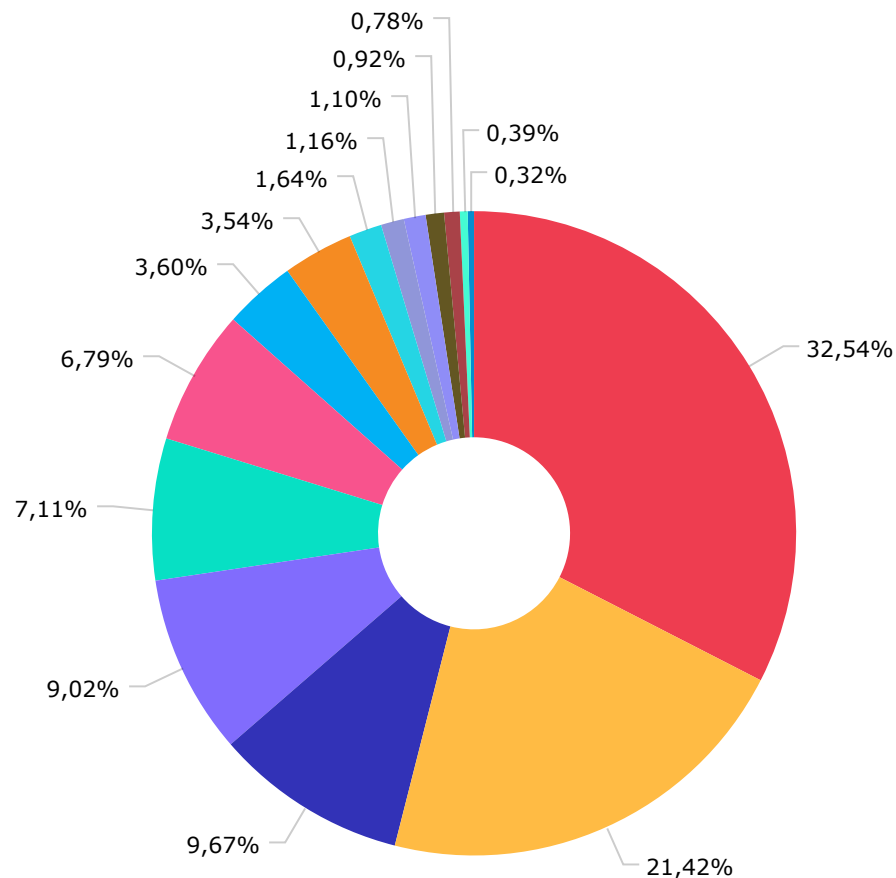


| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior | Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|----------------|------------------------------|--------|----------|--------|----------|---------------|
| 7° I a - Títulos TN SELIC | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 100,00% | 285.724.379,96 | 8° I - Fundos de Ações | 17,07% | 0,00% | 22,00% | 30,00% | 36.940.672,60 |
| 7° I b - FI 100% Títulos TN | 62,78% | 0,00% | 42,00% | 100,00% | 106.349.523,92 | 9° III - Ações - BDR Nível I | 0,00% | 0,00% | 8,00% | 10,00% | 28.572.438,00 |
| 7° III a - FI Referenciados RF | 4,97% | 0,00% | 12,00% | 60,00% | 157.228.681,31 | 10° I - Fundos Multimercados | 3,50% | 0,00% | 6,00% | 10,00% | 18.565.543,28 |
| 7° IV - Ativos Financeiros de ... | 9,41% | 0,00% | 1,00% | 20,00% | 30.251.932,49 | 11° - Fundos Imobiliários | 0,36% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 13.264.841,40 |
| 7° V a - FIDC Cota Sênior | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 14.286.219,00 | | | | | | |
| 7° V b - Fundos de RF - Crédit... | 1,91% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 8.840.498,96 | | | | | | |
| 7° V c - Fundos de Debentures ... | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 14.286.219,00 | | | | | | |

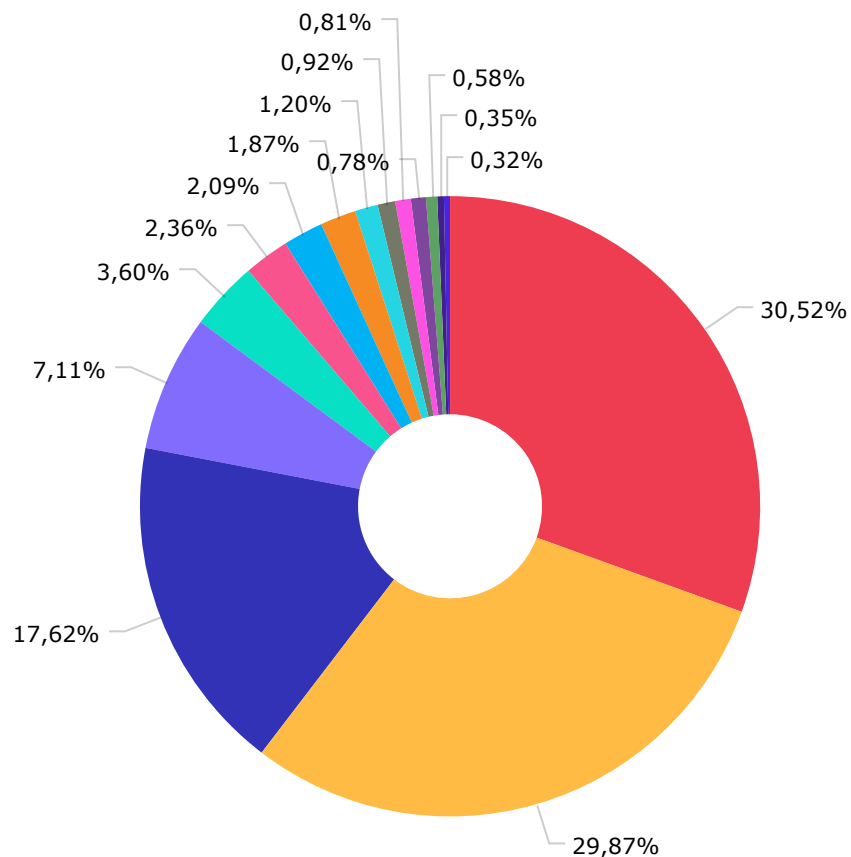
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|--|-------|-------|--------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| NÃO DEFINIDO - BENCHMARK | | | | | | | | |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 0,58 | 10,46 | 1,97 | 6,25 | 10,86 | | 0,90 | 1,89 |
| CDI - BENCHMARK | | | | | | | | |
| SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRVADO | 1,06 | 11,58 | 3,34 | 6,88 | 14,18 | 28,55 | 0,04 | 0,09 |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES | 0,98 | 10,97 | 3,13 | 6,54 | 13,32 | 26,36 | 0,01 | 0,02 |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO | 0,98 | 10,81 | 3,08 | 6,42 | 13,15 | 25,87 | 0,00 | 0,00 |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO | 0,87 | 9,92 | 2,83 | 6,12 | 11,99 | 26,66 | 0,24 | 0,50 |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1,01 | 8,80 | 3,29 | 6,87 | 11,14 | 24,68 | 0,02 | 0,04 |
| SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | -3,07 | 16,98 | -7,58 | 6,39 | 8,14 | | 5,29 | 11,13 |
| IBOVESPA - BENCHMARK | | | | | | | | |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES | -6,04 | 30,87 | -1,01 | 30,79 | 11,87 | 52,68 | 9,41 | 19,82 |
| QLZ MOS FI AÇÕES | -6,67 | 14,71 | -13,44 | 16,93 | 7,09 | 17,59 | 12,00 | 25,27 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO | -1,13 | 3,94 | -3,43 | 4,24 | 3,04 | | 2,55 | 5,38 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO | 0,61 | 3,00 | 0,87 | 1,32 | 1,66 | | 3,51 | 7,40 |
| PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES | -1,90 | 7,22 | -4,16 | 7,93 | 1,56 | 29,94 | 7,33 | 15,43 |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES | -3,61 | 1,59 | -7,80 | 8,08 | -4,91 | 5,72 | 7,29 | 15,35 |
| OCCAM FIC AÇÕES | -2,37 | -0,28 | -7,27 | 5,51 | -8,03 | 4,99 | 6,37 | 13,41 |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | -3,26 | -3,71 | -7,91 | 5,64 | -9,36 | -3,84 | 6,77 | 14,26 |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | -5,29 | 0,47 | -9,76 | 7,47 | -10,82 | -1,56 | 8,34 | 17,56 |
| BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | -3,84 | -1,26 | -10,15 | 8,71 | -11,92 | -12,65 | 9,47 | 19,94 |
| IBX - BENCHMARK | | | | | | | | |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | -6,30 | -0,81 | -13,08 | 3,12 | -12,18 | -11,03 | 10,45 | 22,01 |
| IDIV - BENCHMARK | | | | | | | | |
| | -3,15 | 7,18 | -4,65 | 7,57 | 6,28 | 23,78 | | |

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------------|--------------|--------------|--------------|-------------|--------------|-----------|--------------------|
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | -3,01 | 6,51 | -5,85 | 6,96 | 0,57 | 16,55 | 6,05 | 12,73 |
| 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 |
| BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | -0,66 | 9,80 | -2,14 | 3,62 | 8,74 | 19,84 | 3,12 | 6,57 |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,67 | 9,82 | -2,03 | 3,63 | 8,70 | 20,76 | 3,00 | 6,32 |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | -0,66 | 9,55 | -2,31 | 4,02 | 8,52 | 20,60 | 3,25 | 6,84 |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,44 | 3,42 | -0,16 | 1,82 | 4,24 | 10,44 | 0,48 | 1,00 |
| 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 |
| IMA-B 5+ - BENCHMARK | -0,98 | 10,98 | -4,11 | 3,97 | 8,37 | 19,37 | | |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -0,96 | 10,67 | -4,03 | 3,84 | 8,00 | 18,61 | 4,57 | 9,63 |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,99 | 10,63 | -4,17 | 3,78 | 7,96 | 18,56 | 4,60 | 9,68 |
| 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 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,44 | 9,29 | 2,46 | 4,49 | 10,17 | | 0,48 | 1,00 |
| RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA | 0,25 | | 1,28 | | | | 2,27 | 4,78 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,44 | | 2,48 | | | | 0,48 | 1,00 |
| IFIX - BENCHMARK | -1,97 | 10,06 | -1,30 | 10,41 | 5,49 | 17,94 | | |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | -2,01 | 26,86 | -0,20 | 26,58 | 15,32 | 12,60 | 4,83 | 10,18 |

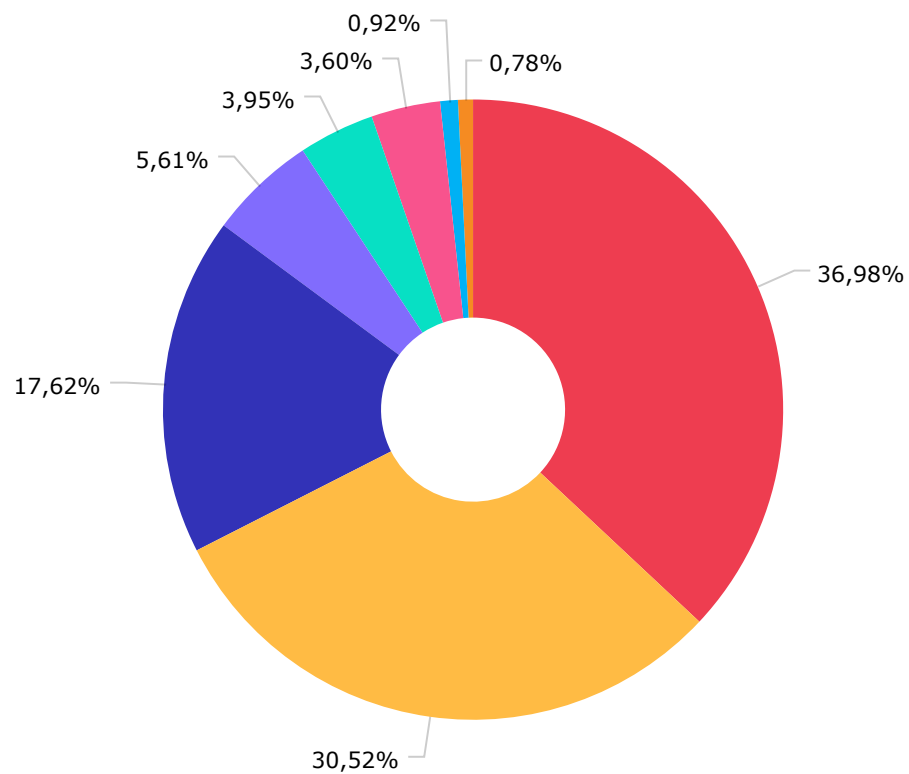




| | |
|---|---------------|
| Renda Fixa Indexados | 84.883.081,85 |
| Renda Fixa Duração Livre Soberano | 55.875.072,64 |
| Renda Fixa Duração Alta Soberano | 25.236.060,16 |
| Ações Livre | 23.522.497,98 |
| Ações Dividendos | 18.548.428,91 |
| Não classificado | 17.722.579,06 |
| Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento | 9.403.824,62 |
| Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento | 9.225.641,16 |
| Multimercados Livre | 4.286.143,77 |
| Ações Valor/Crescimento | 3.023.775,30 |
| Ações Sustentabilidade/Governança | 2.859.061,62 |
| Renda Fixa Simples | 2.401.014,21 |
| Disponibilidades Financeiras | 2.036.200,52 |
| FII TVM Gestão Ativa | 1.021.377,60 |
| Ações Índice Ativo | 822.877,58 |



| | |
|-----------------------------------|---------------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 79.624.927,09 |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 77.921.827,03 |
| BANESTES DISTRIBUIDORA DE TÍTU... | 45.975.511,64 |
| VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU... | 18.548.428,91 |
| TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA | 9.396.607,34 |
| RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA | 6.157.946,02 |
| BANCO J. SAFRA S.A | 5.445.720,04 |
| SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA. | 4.871.149,63 |
| MOS GESTÃO DE INVESTIMENTOS LT... | 3.118.080,85 |
| ITAU UNIBANCO S.A. | 2.401.014,21 |
| PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE... | 2.122.033,42 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 2.036.200,52 |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA. | 1.523.570,82 |
| OCCAM BRASIL GESTÃO DE RECURSO... | 901.741,88 |
| SOMMA INVESTIMENTOS S.A. | 822.877,58 |



| | |
|-----------------------------------|---------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 96.470.255,94 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. | 79.624.927,09 |
| BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO... | 45.975.511,64 |
| BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E... | 14.646.250,57 |
| SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA. | 10.316.869,67 |
| BANCO DAYCOVAL S.A. | 9.396.607,34 |
| ITAU UNIBANCO S.A. | 2.401.014,21 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 2.036.200,52 |

| 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% |
| Outubro | 273.370.289,34 | 29.161.500,02 | 14.345.799,12 | 285.724.379,96 | -2.461.610,28 | 21.153.188,42 | -0,85% ▼ | 8,18% | 0,66% | 8,20% | 99,76% | 2,66% |

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

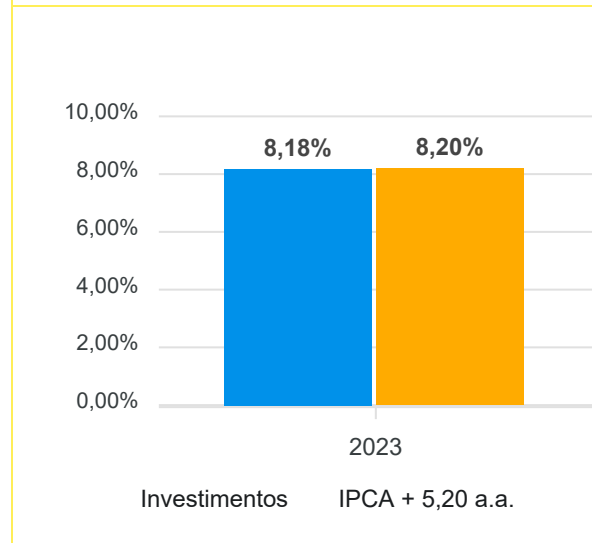


Gráfico Risco x Retorno

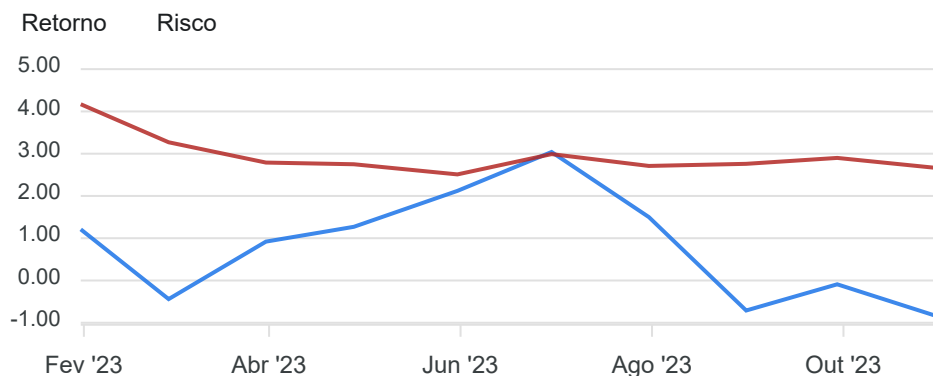
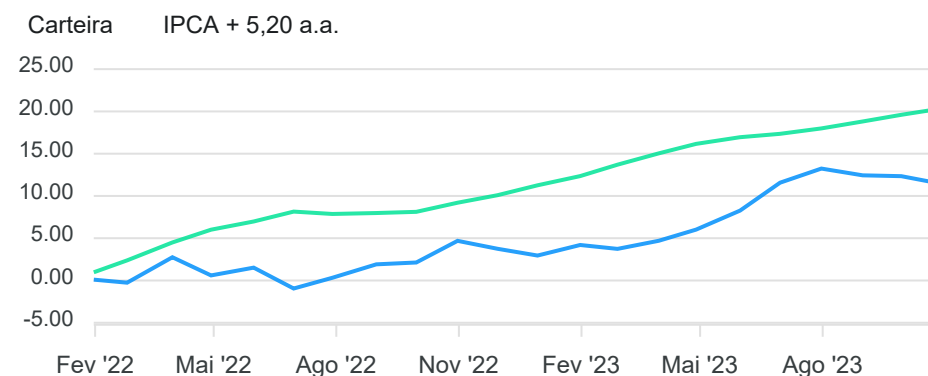
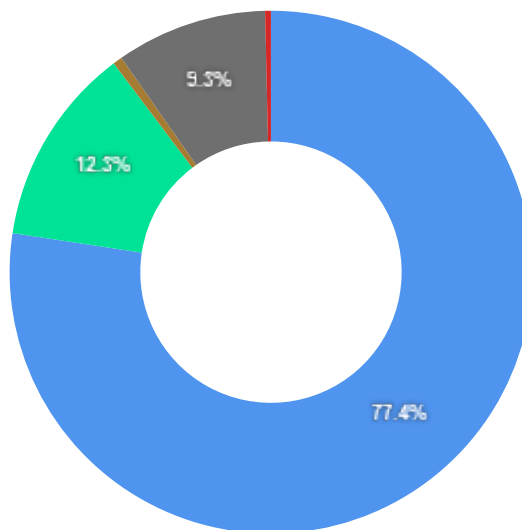


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/10/2023

| Disponibilidade | Valor | % |
|-----------------|----------------|-------|
| Até D+30 | 222.686.521,83 | 77,94 |
| Até D+180 | 35.500.741,99 | 12,42 |
| Até D+360 | 1.658.995,56 | 0,58 |
| Até D+720 | 26.892.943,50 | 9,41 |
| Até D+1800 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Acima D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Indeterminado | 1.021.377,60 | 0,36 |



| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|---------------|------------|----------------|-------------|-----------|-------------|
| BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 25.403.073,50 | 0,00 | 0,00 | 25.236.060,16 | -167.013,34 | -0,66% ▼ | 3,12% |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | 9.286.699,45 | 0,00 | 0,00 | 9.225.641,16 | -61.058,29 | -0,66% ▼ | 3,25% |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 2.783.977,11 | 2.050.000,00 | 905.000,00 | 3.958.104,58 | 29.127,47 | 0,60% ▲ | 0,02% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 18.291.633,58 | 0,00 | 0,00 | 18.447.262,57 | 155.628,99 | 0,85% ▲ | 0,26% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 6.527.562,99 | 0,00 | 0,00 | 6.506.414,72 | -21.148,27 | -0,32% ▼ | 1,43% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 4.326.527,43 | 0,00 | 0,00 | 4.283.776,36 | -42.751,07 | -0,99% ▼ | 4,60% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 36.636.717,43 | 0,00 | 0,00 | 36.389.818,89 | -246.898,54 | -0,67% ▼ | 3,00% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 5.698.740,36 | 5.255.585,58 | 0,00 | 10.979.627,18 | 25.301,24 | 0,23% ▲ | 0,48% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 158.275,66 | 0,00 | 0,00 | 158.965,75 | 690,09 | 0,44% ▲ | 0,48% |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO | 13.627.402,00 | 21.855.914,44 | 0,00 | 35.768.814,51 | 285.498,07 | 0,80% ▲ | 0,00% |
| CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.493.522,62 | 0,00 | 0,00 | 1.500.029,81 | 6.507,19 | 0,44% ▲ | 0,48% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 22.575.704,40 | 0,00 | 0,00 | 22.503.078,51 | -72.625,89 | -0,32% ▼ | 1,43% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2.413.387,92 | 0,00 | 0,00 | 2.390.169,88 | -23.218,04 | -0,96% ▼ | 4,57% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 12.895.509,50 | 0,00 | 0,00 | 12.809.823,49 | -85.686,01 | -0,66% ▼ | 3,00% |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES | 2.377.784,31 | 0,00 | 0,00 | 2.401.014,21 | 23.229,90 | 0,98% ▲ | 0,01% |
| LF BRADESCO 05/06/2025 IPCA + 6,38% | 8.459.067,44 | 0,00 | 0,00 | 8.526.037,02 | 66.969,58 | 0,79% ▲ | - |
| LF DAYCOVAL 06/06/2025 IPCA + 7,12% | 13.100.467,21 | 0,00 | 0,00 | 13.211.844,16 | 111.376,95 | 0,85% ▲ | - |
| LF SANTANDER 05/06/2025 IPCA + 6,45% | 5.116.509,77 | 0,00 | 0,00 | 5.155.062,32 | 38.552,55 | 0,75% ▲ | - |
| RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA | 1.019.615,27 | 0,00 | 0,00 | 1.022.200,93 | 2.585,66 | 0,25% ▲ | 2,27% |
| SAFRA EXTRA BANCOS FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 5.388.540,46 | 0,00 | 0,00 | 5.445.720,04 | 57.179,58 | 1,06% ▲ | 0,04% |
| | 197.580.718,41 | 29.161.500,02 | 905.000,00 | 225.919.466,25 | 82.247,82 | 0,04% | 1,51% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|---------------|---------------|---------------|-----------|-------------|
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 1.626.063,94 | 0,00 | 0,00 | 1.523.570,82 | -102.493,12 | -6,30% ▼ | 10,45% |
| BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 7.857.242,45 | 0,00 | 0,00 | 7.555.705,74 | -301.536,71 | -3,84% ▼ | 9,47% |
| BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES | 5.409.345,81 | 0,00 | 5.255.585,58 | 0,00 | -153.760,23 | -2,84% ▼ | 7,26% |
| BB GOVERNANÇA IS FIAÇÕES | 2.966.277,12 | 0,00 | 0,00 | 2.859.061,62 | -107.215,50 | -3,61% ▼ | 7,29% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 3.799.436,21 | 0,00 | 1.763.252,12 | 1.928.533,23 | -107.650,86 | -2,83% ▼ | 8,34% |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVSPA FIAÇÕES | 6.604.662,73 | 0,00 | 6.421.961,42 | 0,00 | -182.701,31 | -2,77% ▼ | 7,15% |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 19.124.580,23 | 0,00 | 0,00 | 18.548.428,91 | -576.151,32 | -3,01% ▼ | 6,05% |
| OCCAM FIC AÇÕES | 923.592,92 | 0,00 | 0,00 | 901.741,88 | -21.851,04 | -2,37% ▼ | 6,37% |
| PLURAL DIVIDENDOS FIAÇÕES | 2.163.193,80 | 0,00 | 0,00 | 2.122.033,42 | -41.160,38 | -1,90% ▼ | 7,33% |
| QLZ MOS FIAÇÕES | 3.340.882,95 | 0,00 | 0,00 | 3.118.080,85 | -222.802,10 | -6,67% ▼ | 12,00% |
| SOMMA BRASIL FIAÇÕES | 850.592,06 | 0,00 | 0,00 | 822.877,58 | -27.714,48 | -3,26% ▼ | 6,77% |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES | 10.000.791,96 | 0,00 | 0,00 | 9.396.607,34 | -604.184,62 | -6,04% ▼ | 9,41% |
| - | 64.666.662,18 | 0,00 | 13.440.799,12 | 48.776.641,39 | -2.449.221,67 | -3,79% | 7,98% |

| ESTRUTURADOS | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|---------------|------------|-----------|-------------|
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 2.203.700,60 | 0,00 | 0,00 | 2.216.521,92 | 12.821,32 | 0,58% ▲ | 0,90% |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO | 2.150.210,32 | 0,00 | 0,00 | 2.125.993,74 | -24.216,58 | -1,13% ▼ | 2,55% |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO | 788.448,17 | 0,00 | 0,00 | 793.229,43 | 4.781,26 | 0,61% ▲ | 3,51% |
| SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 2.796.777,03 | 0,00 | 0,00 | 2.710.999,60 | -85.777,43 | -3,07% ▼ | 5,29% |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO | 2.141.435,83 | 0,00 | 0,00 | 2.160.150,03 | 18.714,20 | 0,87% ▲ | 0,24% |
| - | 10.080.571,95 | 0,00 | 0,00 | 10.006.894,72 | -73.677,23 | -0,73% | 2,50% |

| FUNDOS IMOBILIÁRIOS | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 1.042.336,80 | 0,00 | 0,00 | 1.021.377,60 | -20.959,20 | -2,01% ▼ | 4,83% |
| - | 1.042.336,80 | 0,00 | 0,00 | 1.021.377,60 | -20.959,20 | -2,01% | 4,83% |

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