

2023

Relatório Mensal

Fevereiro

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	1.177.369,27	3,45%	6.918.204.948,36	0,02%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	677.764,30	1,99%	736.399.019,77	0,09%	7º I b
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	5.479.986,66	16,06%	2.987.254.830,35	0,18%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	252.878,36	0,74%	937.727.381,64	0,03%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.514.104,66	7,37%	233.663.337,48	1,08%	7º I b
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.197.078,50	12,30%	1.472.734.911,86	0,28%	7º I b
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	1.416.186,15	4,15%	1.062.549.419,34	0,13%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.319.001,53	6,80%	3.964.919.513,24	0,06%	7º III a
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.941.463,78	14,48%	595.660.758,13	0,83%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.429.287,26	4,19%	13.891.144.708,98	0,01%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	2.269.037,11	6,65%	2.496.061.867,24	0,09%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	613.141,28	1,80%	1.291.004.024,17	0,05%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1.214.714,82	3,56%	478.052.303,48	0,25%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	543.075,49	1,59%	320.399.671,45	0,17%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.439.760,12	4,22%	408.116.405,03	0,35%	7º III a
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	368.914,57	1,08%	361.019.606,18	0,10%	8º I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	247.162,71	0,72%	872.050.349,56	0,03%	8º I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.131.594,62	3,32%	783.163.513,62	0,14%	8º I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	207.735,41	0,61%	615.348.910,84	0,03%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	165.529,86	0,49%	2.013.092.468,90	0,01%	8º I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	447.108,83	1,31%	195.858.750,12	0,23%	8º I
SICREDI PETROBRAS FI AÇÕES	35.012,57	0,10%	89.489.560,71	0,04%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	469.126,35	1,38%	1.983.611.681,32	0,02%	9º III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	194.259,65	0,57%	1.139.873.707,23	0,02%	10º I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	195.590,32	0,57%	188.200.992,08	0,10%	10º I
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	169.187,68	0,50%	5.903.070,46	2,87%	10º II

Investimentos

\$ 34.116.071,86

Disponibilidades Financeiras

\$ 631.036,79

Total Carteira

\$ 34.747.108,65

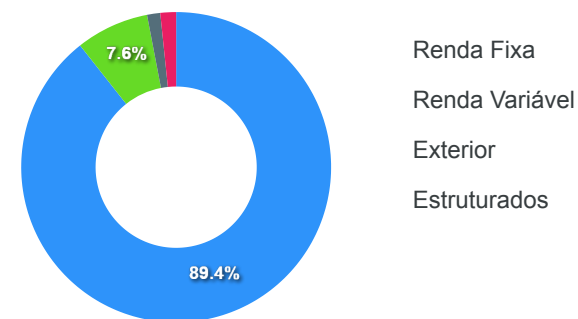
Governança (Pró Gestão)
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	46,06% 15.715.367,90	53,94% 18.400.703,96
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	43,29% 14.769.481,39	16,71% 5.700.161,73
8º I - Fundos de Ações	30,00%	7,63% 2.603.058,57	22,37% 7.631.762,99
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,38% 469.126,35	8,62% 2.942.480,84
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	1,14% 389.849,97	8,86% 3.021.757,22
10º II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	0,50% 169.187,68	4,50% 1.536.615,91

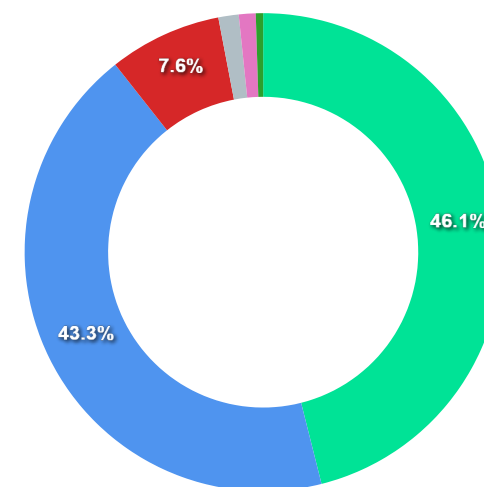
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



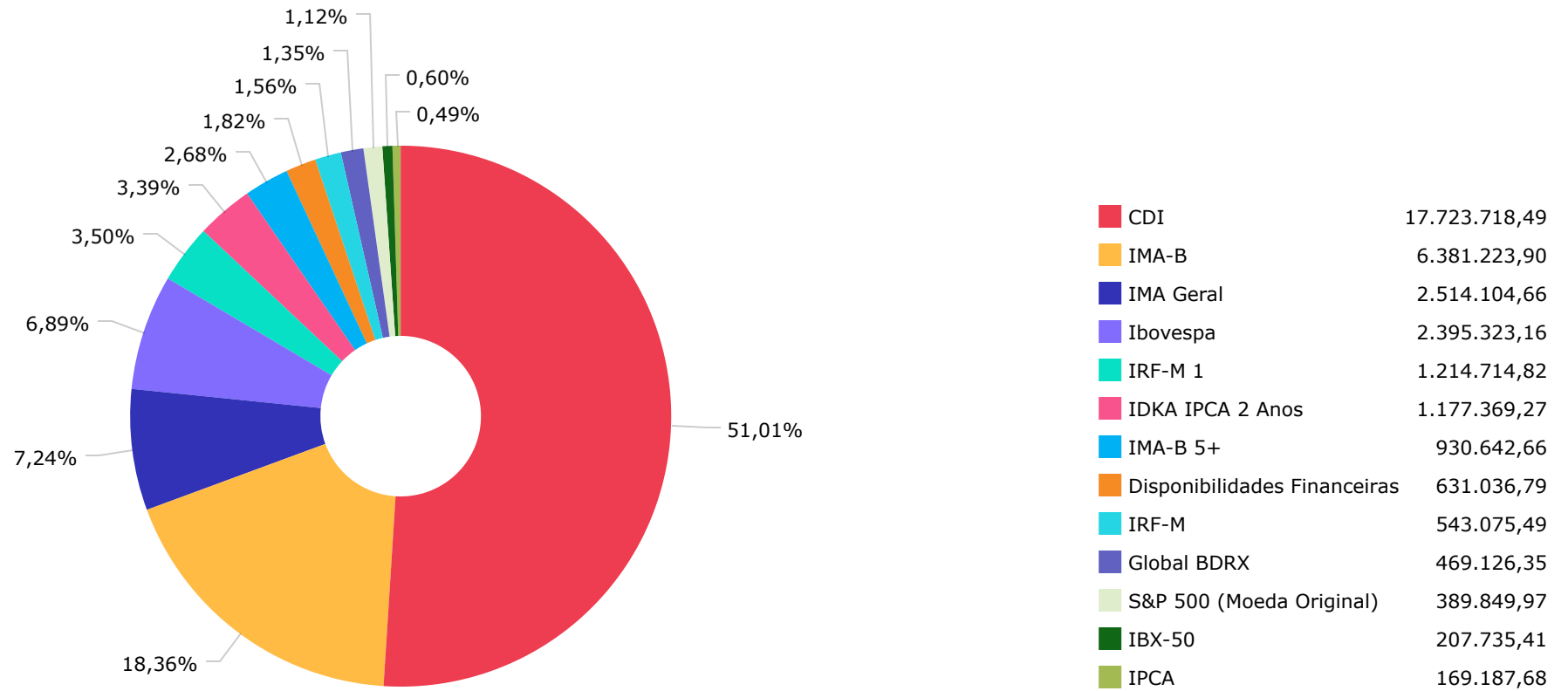
Artigos

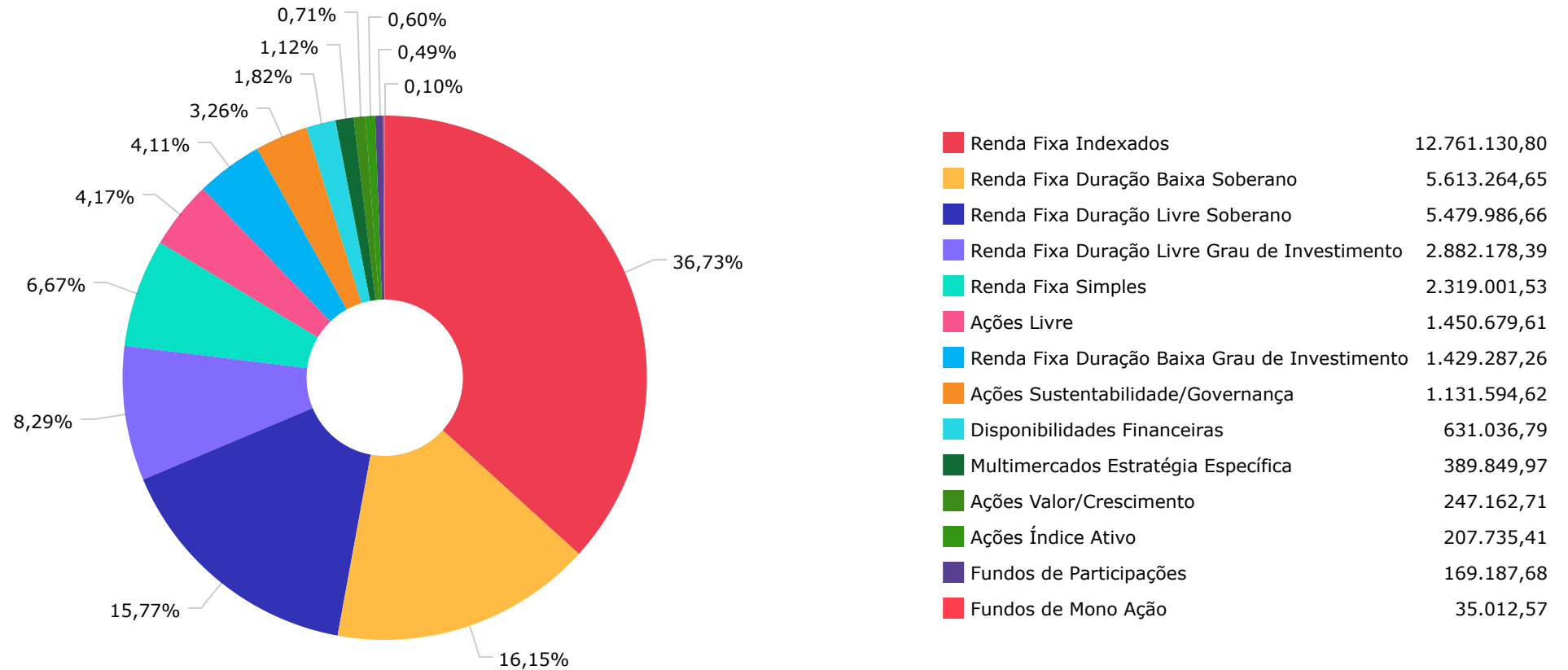


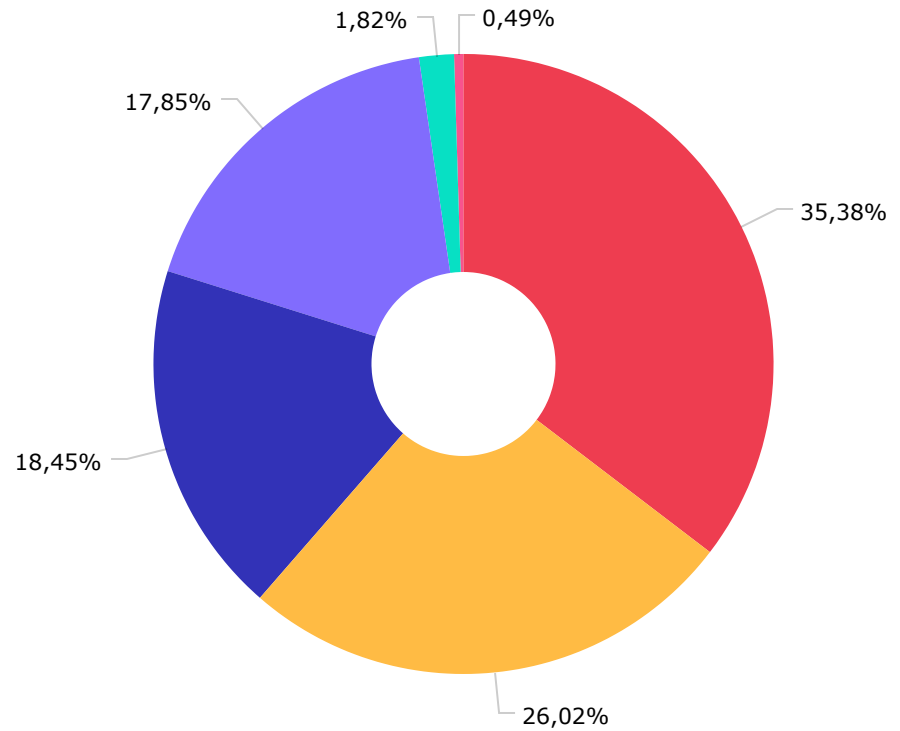
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	34.116.071,86	8° I - Fundos de Ações	7,63%	0,00%	25,00%	30,00%	7.631.762,99
7° I b - FI 100% Títulos TN	46,06%	0,00%	35,00%	100,00%	18.400.703,96	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	10.234.821,56
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	34.116.071,86	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.411.607,19
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.705.803,59	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.411.607,19
7° III a - FI Referenciados RF	43,29%	0,00%	24,00%	60,00%	5.700.161,73	9° III - Ações - BDR Nível I	1,38%	0,00%	5,00%	10,00%	2.942.480,84
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	20.469.643,12	10° I - Fundos Multimercados	1,14%	0,00%	4,00%	10,00%	3.021.757,22
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	6.823.214,37	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,50%	0,00%	1,00%	5,00%	1.536.615,91
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.705.803,59	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.705.803,59
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.705.803,59	11° - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.705.803,59
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.705.803,59	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.705.803,59

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38		
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,99	2,09	3,40	6,40	13,68		0,38	0,81
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,85	1,99	3,13	6,42	13,03	19,82	0,13	0,26
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,93	2,06	3,18	6,42	12,89	19,33	0,01	0,01
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,93	2,05	3,17	6,40	12,83	19,19	0,01	0,02
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,90	2,01	3,14	6,32	12,74	18,81	0,00	0,00
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,87	1,91	3,08	5,74	12,44	21,11	0,26	0,55
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,85	1,89	2,95	5,94	11,87	16,92	0,00	0,01
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	1,15	5,57	1,12	0,53	-9,60	-7,95		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,75	5,10	0,06	0,40	-10,41	-10,52	9,98	21,02
IBOVESPA - BENCHMARK	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64		
SICREDI PETROBRAS FI AÇÕES	-3,18	2,73	-4,01	-12,73	25,29	130,98	17,13	36,07
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-6,80	-4,55	-2,83	-2,67	0,27	-7,23	7,04	14,83
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-6,41	-3,30	-5,92	-6,67	-6,62	-6,97	8,21	17,28
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-7,74	-4,40	-6,90	-5,59	-8,95	-7,83	8,35	17,59
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-7,34	-4,24	-6,62	-7,40	-10,52	-1,82	8,82	18,58
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-9,22	-5,51	-10,05	-16,58	-18,76		8,35	17,58
IBX-50 - BENCHMARK	-7,54	-4,41	-6,85	-3,59	-7,74	-3,34		
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-7,44	-3,01	-5,43	-3,95	-9,01	-6,05	8,12	17,11
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	1,62	3,08	4,36	6,05	11,25	18,71		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,49	2,95	4,20	6,00	11,25	18,21	1,45	3,06
IMA GERAL - BENCHMARK	1,03	1,74	2,52	4,81	10,51	13,70		

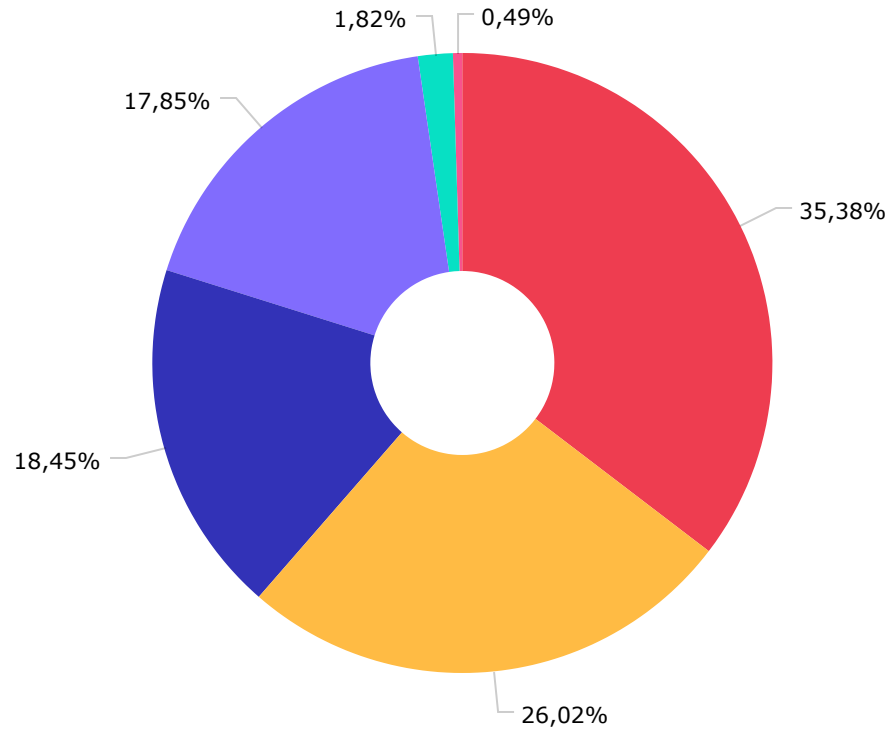
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,26	1,24	1,03	2,90	7,69	8,45	2,47	5,20
IMA-B - BENCHMARK	1,28	1,28	1,08	3,02	7,94	8,94		
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,25	1,15	0,84	2,72	7,67	8,12	2,53	5,33
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25	1,20	0,96	2,85	7,56	8,35	2,46	5,18
IMA-B 5+ - BENCHMARK	1,17	-0,11	-1,30	0,52	4,86	0,42		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,13	-0,16	-1,39	0,39	4,57	-0,32	3,94	8,30
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,15	-0,12	-1,31	0,40	4,54	-0,18	3,89	8,19
IPCA - BENCHMARK	0,84	1,37	2,00	2,73	5,60	16,73		
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,57	-1,13	-2,04	-3,66	-6,86	-17,81		
IRF-M - BENCHMARK	0,86	1,71	3,21	4,93	10,13	10,66		
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	0,86	1,75	3,19	4,81	10,31	10,65	1,52	3,21
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,98	2,09	3,30	6,49	12,81	17,61		
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,96	2,07	3,29	6,46	12,76	17,94	0,27	0,57
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	-2,61	3,40	-2,70	0,38	-9,45	4,17		
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-1,78	4,67	-0,40	5,07	-0,37	19,82	7,64	16,10
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-1,78	4,59	-0,45	4,90	-0,57	19,27	7,62	16,04







BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	12.292.558,04
CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ...	9.041.417,97
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.409.726,78
ITAU UNIBANCO S.A.	6.203.181,39
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	631.036,79
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.	169.187,68



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	12.292.558,04
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	9.041.417,97
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.409.726,78
ITAU UNIBANCO S.A.	6.203.181,39
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	631.036,79
RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL...	169.187,68

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	32.370.621,23	5.233.895,00	4.974.687,94	33.004.844,18	375.015,89	375.015,89	1,15% ▲	1,15%	0,95%	0,95%	121,05%	2,28%
Fevereiro	33.004.844,18	3.461.296,55	2.425.420,04	34.116.071,86	75.351,17	450.367,06	0,22% ▲	1,37%	1,19%	2,15%	63,72%	1,73%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

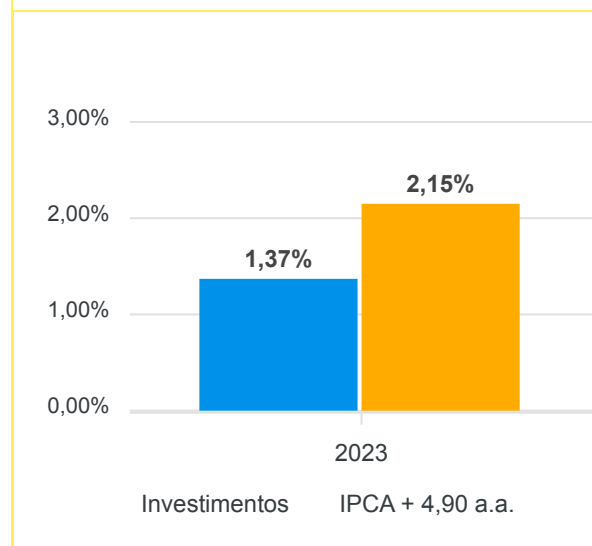


Gráfico Risco x Retorno

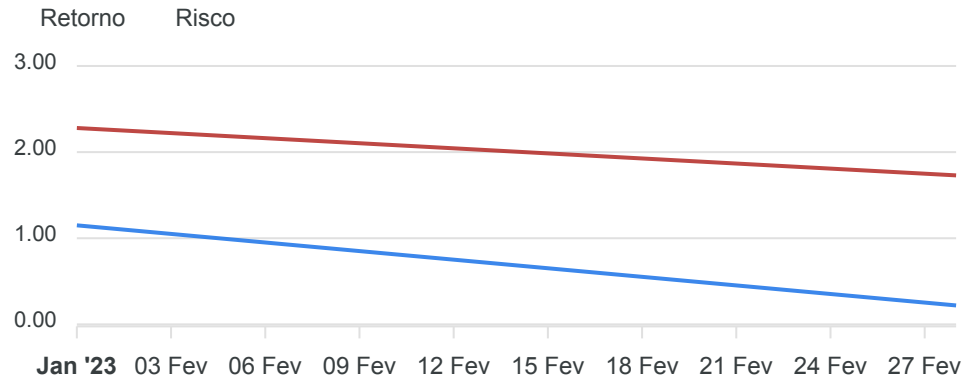
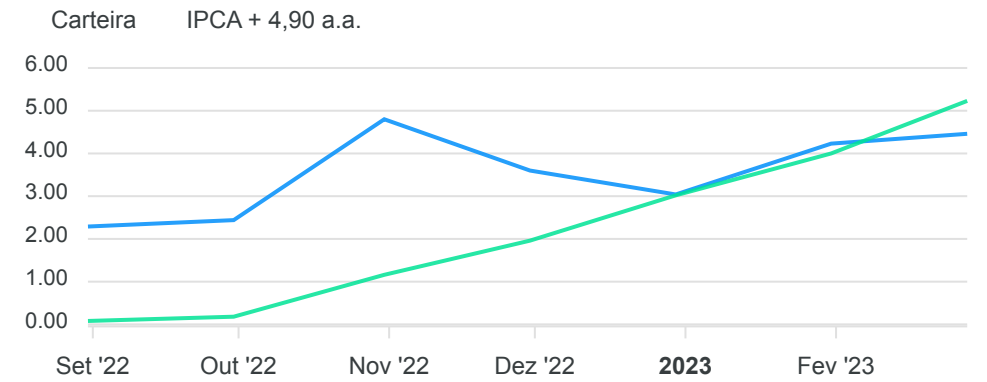
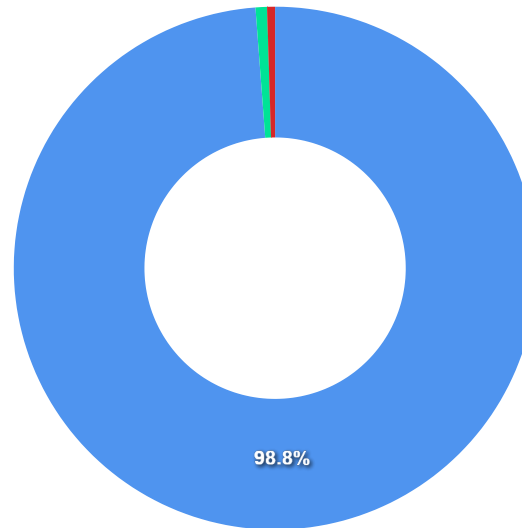


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 28/02/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	34.330.758,26	100,63
Até D+180	247.162,71	0,72
Até D+360	0,00	0,00
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	169.187,68	0,50



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.476.750,85	258.780,19	438.937,59	2.319.001,53	22.408,08	0,82% ▲	0,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.160.080,88	0,00	0,00	1.177.369,27	17.288,39	1,49% ▲	1,45%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	670.043,23	0,00	0,00	677.764,30	7.721,07	1,15% ▲	3,89%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.880.461,16	0,00	0,00	4.941.463,78	61.002,62	1,25% ▲	2,46%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.417.186,18	0,00	0,00	1.429.287,26	12.101,08	0,85% ▲	0,13%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	3.626.256,48	1.806.436,26	0,00	5.479.986,66	47.293,92	0,87% ▲	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	459.485,89	0,00	459.806,35	0,00	320,46	0,07% ▲	0,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	250.040,41	0,00	0,00	252.878,36	2.837,95	1,13% ▲	3,94%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.088.790,26	0,00	1.089.086,39	0,00	296,13	0,03% ▲	1,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	853.653,73	1.396.080,10	0,00	2.269.037,11	19.303,28	0,86% ▲	0,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.482.762,31	0,00	0,00	2.514.104,66	31.342,35	1,26% ▲	2,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	607.143,52	0,00	0,00	613.141,28	5.997,76	0,99% ▲	0,38%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1.203.119,08	0,00	0,00	1.214.714,82	11.595,74	0,96% ▲	0,27%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	538.447,88	0,00	0,00	543.075,49	4.627,61	0,86% ▲	1,52%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.422.043,71	0,00	0,00	1.439.760,12	17.716,41	1,25% ▲	2,53%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.158.473,58	0,00	0,00	4.197.078,50	38.604,92	0,93% ▲	0,01%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	1.403.177,51	0,00	0,00	1.416.186,15	13.008,64	0,93% ▲	0,01%
	28.697.916,66	3.461.296,55	1.987.830,33	30.484.849,29	313.466,41	1,04%	0,97%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	394.190,55	0,00	0,00	368.914,57	-25.275,98	-6,41% ▼	8,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	266.731,72	0,00	0,00	247.162,71	-19.569,01	-7,34% ▼	8,82%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.226.489,03	0,00	0,00	1.131.594,62	-94.894,41	-7,74% ▼	8,35%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	680.522,29	0,00	437.589,71	207.735,41	-35.197,17	-5,17% ▼	8,12%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	177.607,88	0,00	0,00	165.529,86	-12.078,02	-6,80% ▼	7,04%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	492.511,85	0,00	0,00	447.108,83	-45.403,02	-9,22% ▼	8,35%
SICREDI PETROBRAS FI AÇÕES	36.163,88	0,00	0,00	35.012,57	-1.151,31	-3,18% ▼	17,13%
-	3.274.217,20	0,00	437.589,71	2.603.058,57	-233.568,92	-7,13%	8,39%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	170.154,99	0,00	0,00	169.187,68	-967,31	-0,57% ▼	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	197.789,08	0,00	0,00	194.259,65	-3.529,43	-1,78% ▼	7,62%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	199.130,87	0,00	0,00	195.590,32	-3.540,55	-1,78% ▼	7,64%
-	567.074,94	0,00	0,00	559.037,65	-8.037,29	-1,42%	5,32%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	465.635,38	0,00	0,00	469.126,35	3.490,97	0,75% ▲	9,98%
	465.635,38	0,00	0,00	469.126,35	3.490,97	0,75%	0,00%

Cenário Econômico

A euforia com o bom desempenho no primeiro mês do ano passou rápido, e a volatilidade segue forte a exemplo do que foi o ano de 2022. O segmento de renda fixa teve desempenho levemente superior ao mês de janeiro e além da rentabilidade positiva do CDI e títulos públicos, os fundos atrelados a inflação também tiveram um bom desempenho. Já a renda variável local, na contramão do mês anterior, fechou o mês em forte baixa, principalmente os fundos de Small Caps, no geral os principais benchmarks dessa estratégia já estão acumulando significativas volatilidades no acumulado de 2023. Por fim, os investimentos no exterior, que na primeira quinzena do mês apresentavam resultados positivos, com a piora do cenário econômico global, inverteram a direção e fecharam em baixa. Para os clientes que possuem carteiras mais diversificadas, o mês foi de resultado bem abaixo da meta atuarial.

Apesar da reoneração dos impostos dos combustíveis e previsão da reforma tributária, o mercado ainda aguarda sinais mais evidentes da condução econômica do novo governo, com isso, tem cobrado níveis elevados na remuneração dos títulos públicos federais, que permanecem com taxas extremamente atrativas garantindo o batimento da meta atuarial em todos os vértices e com risco soberano. As Letras Financeiras, também tem oferecido boa remuneração e podem ser um bom atrativo para este momento de mercado. Além do mais, o CDI, com a manutenção da Taxa Selic elevada por mais tempo, segue como um investimento confortável. Nada diferente do que temos falado, a renda variável local segue com forte volatilidade. Consideramos um bom ponto de entrada focando na gestão de médio e longo prazo, já que os índices permanecem extremamente descontados.

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

Como já dissemos, a euforia com o bom desempenho no primeiro mês do ano passou rápido, e a volatilidade voltou forte a exemplo do que foi o ano de 2022. O segmento de renda fixa teve desempenho levemente superior ao mês de janeiro e além da rentabilidade positiva do CDI e títulos públicos, os fundos atrelados a inflação também tiveram um bom desempenho. Já a renda variável e os investimentos no exterior, na contramão do mês anterior, fecharam o mês com resultados desfavoráveis, seguindo os principais benchmarks dessa estratégia.

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, 10 de março de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

