

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	1.241.917,24	3,26%	6.063.437.379,24	0,02%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	758.269,69	1,99%	1.516.152.288,42	0,05%	7º I b
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	7.674.650,68	20,16%	4.578.244.933,29	0,17%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.664.652,31	4,37%	267.272.249,83	0,62%	7º I b
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.094.406,36	16,01%	1.956.686.337,58	0,31%	7º I b
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	1.525.070,55	4,01%	1.180.211.642,67	0,13%	7º I b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.749.731,04	4,60%	3.380.807.738,12	0,05%	7º III a
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.499.189,91	6,56%	923.636.374,46	0,27%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.853.519,39	12,75%	15.259.689.366,93	0,03%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	3.499.874,16	9,19%	2.836.954.249,95	0,12%	7º III a
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	659.496,04	1,73%	1.381.611.780,76	0,05%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1.311.151,85	3,44%	657.761.377,45	0,20%	7º III a
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	595.814,89	1,56%	563.913.337,62	0,11%	7º III a
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	407.304,12	1,07%	327.129.697,52	0,12%	8º I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	263.336,71	0,69%	809.353.434,17	0,03%	8º I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.247.501,85	3,28%	762.055.294,68	0,16%	8º I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	222.113,24	0,58%	640.753.823,10	0,03%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	166.153,97	0,44%	1.645.975.612,64	0,01%	8º I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	461.826,80	1,21%	153.528.152,83	0,30%	8º I
SICREDI PETROBRAS FI AÇÕES	57.366,53	0,15%	139.775.789,17	0,04%	8º I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	517.991,25	1,36%	1.999.422.357,55	0,03%	9º III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	218.773,67	0,57%	1.122.626.979,16	0,02%	10º I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	220.922,64	0,58%	187.594.614,14	0,12%	10º I
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	162.416,54	0,43%	5.666.820,46	2,87%	10º II

Investimentos

\$ 38.073.451,43

Disponibilidades Financeiras

\$ 22.596,19

Total Carteira

\$ 38.096.047,62

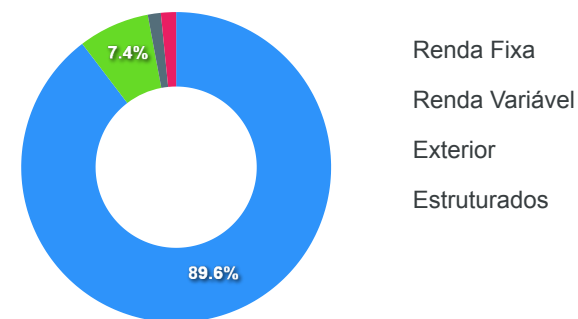
Governança (Pró Gestão)


Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	49,80%	18.958.966,83 50,20%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	39,84%	15.168.777,28 20,16%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	7,42%	2.825.603,22 22,58%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	1,36%	517.991,25 8,64%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	1,15%	439.696,31 8,85%
10º II - Fundos em Participações (FIP)	5,00%	0,43%	162.416,54 4,57%

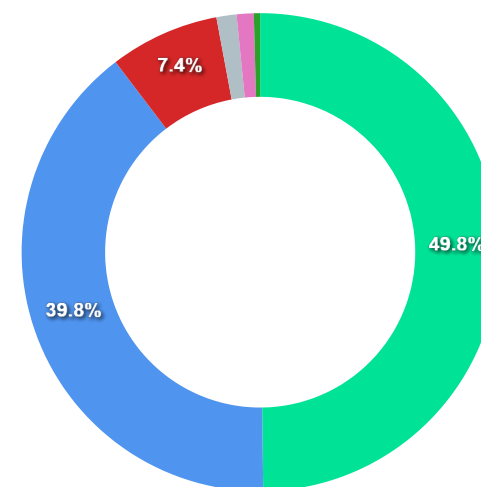
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



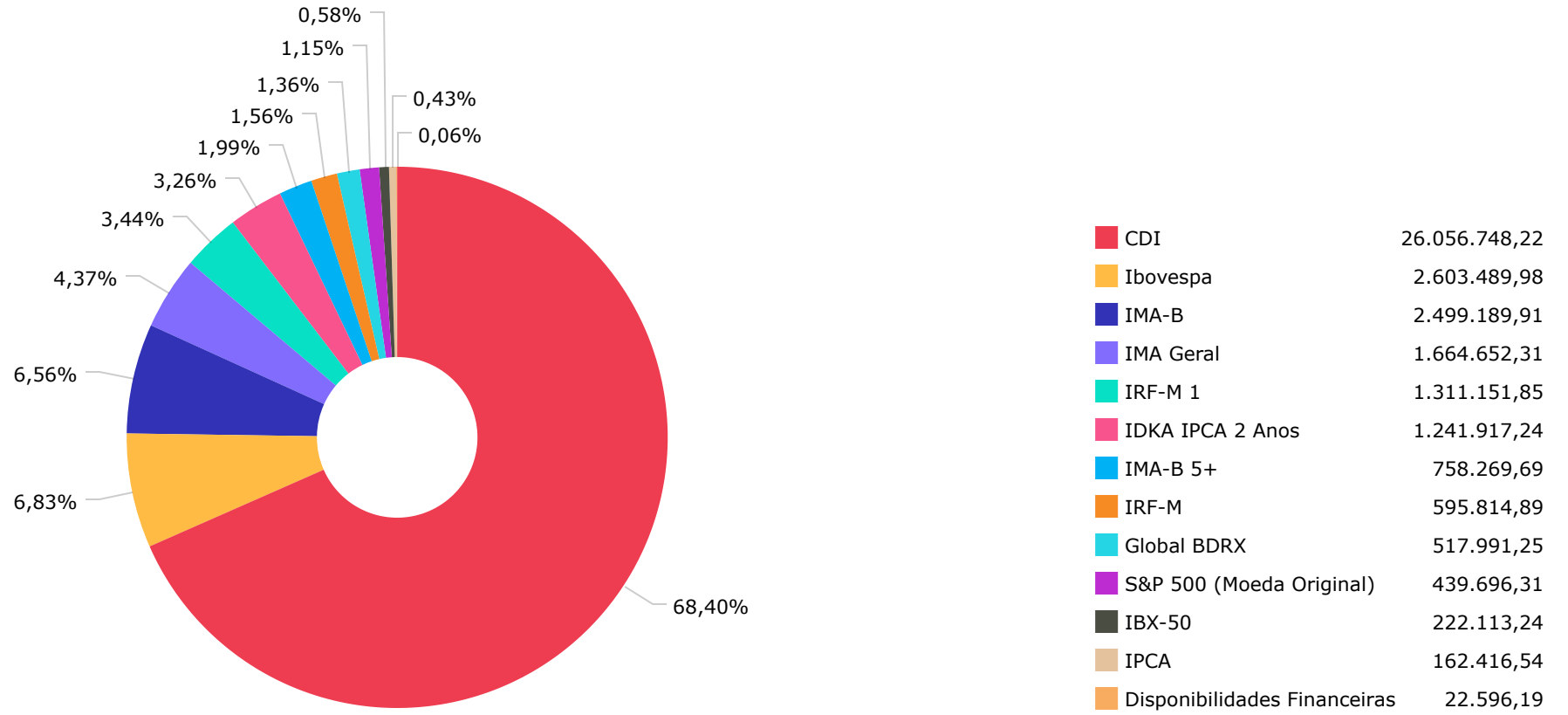
Artigos

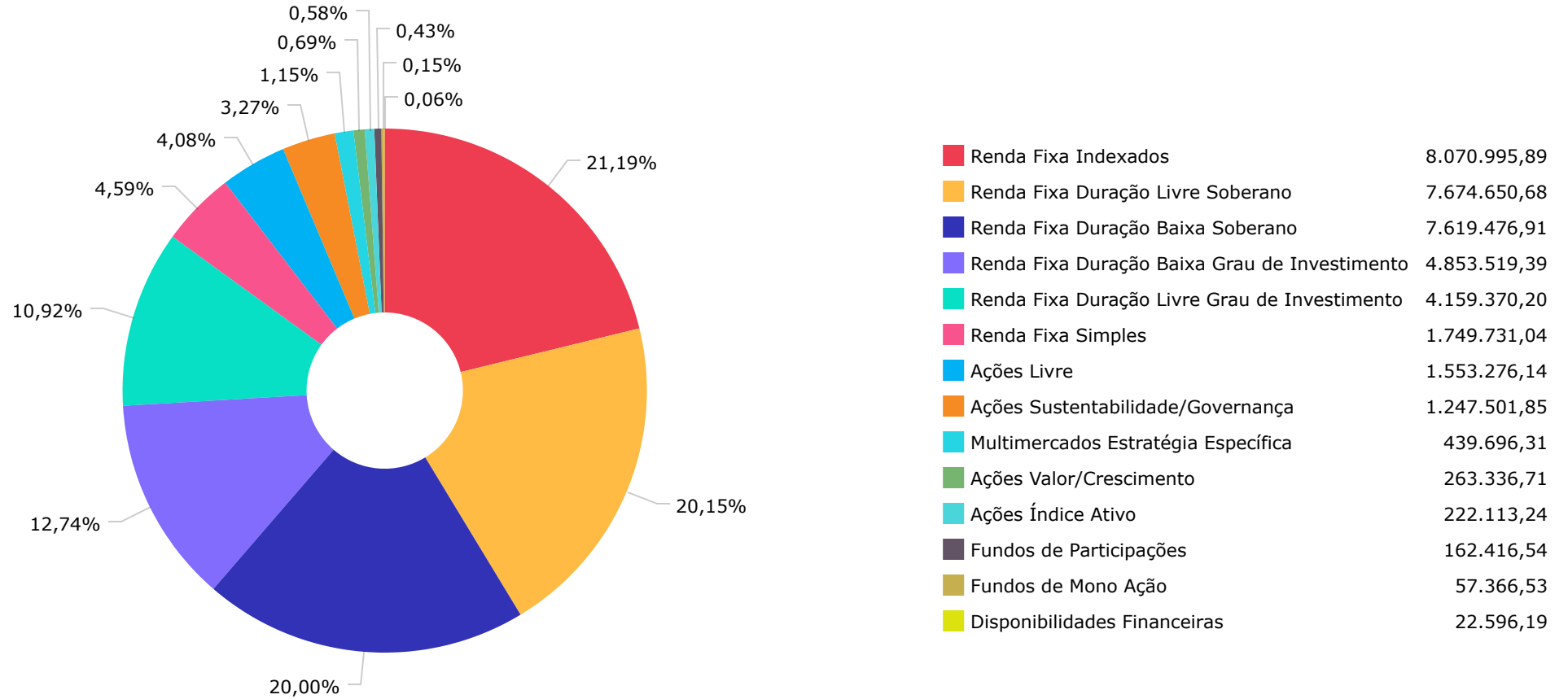


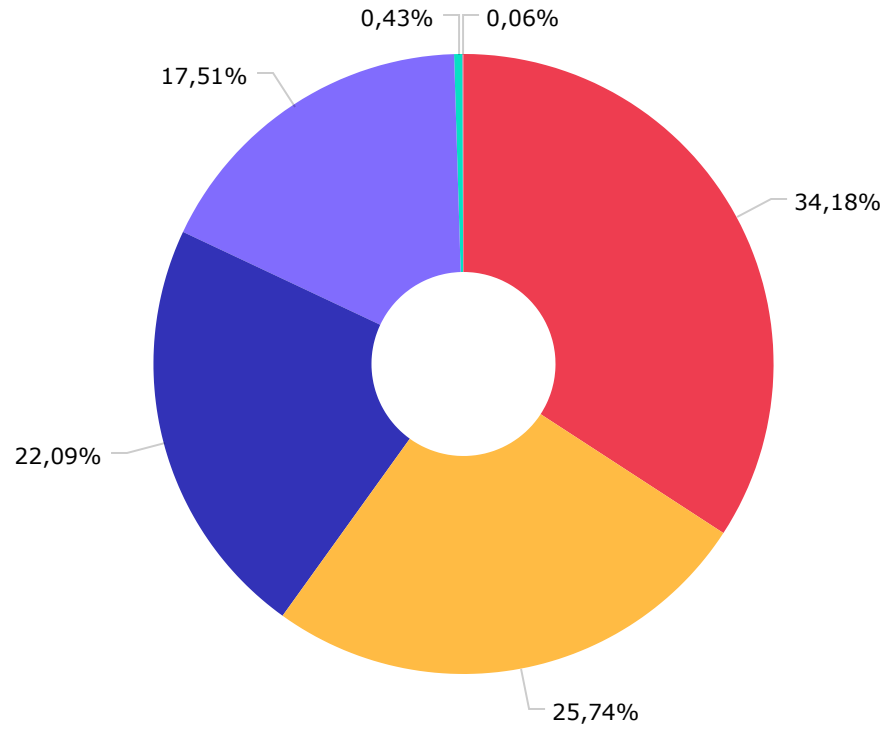
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	38.073.451,43	8° I - Fundos de Ações	7,42%	0,00%	25,00%	30,00%	8.596.432,21
7° I b - FI 100% Títulos TN	49,80%	0,00%	35,00%	100,00%	19.114.484,60	8° II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	11.422.035,43
7° I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	38.073.451,43	9° I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.807.345,14
7° II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.903.672,57	9° II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.807.345,14
7° III a - FI Referenciados RF	39,84%	0,00%	24,00%	60,00%	7.675.293,58	9° III - Ações - BDR Nível I	1,36%	0,00%	5,00%	10,00%	3.289.353,89
7° III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	22.844.070,86	10° I - Fundos Multimercados	1,15%	0,00%	4,00%	10,00%	3.367.648,83
7° IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	7.614.690,29	10° II - Fundos em Participaçõ...	0,43%	0,00%	1,00%	5,00%	1.741.256,03
7° V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.903.672,57	10° III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.903.672,57
7° V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.903.672,57	11° - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.903.672,57
7° V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.903.672,57	12° - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.903.672,57

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80		
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,99	9,95	3,25	6,51	13,43	25,82	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
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,98	9,89	3,23	6,48	13,36	25,66	0,02	0,04
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
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,76	9,81	2,91	6,24	13,10	27,68	0,24	0,50
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90	9,12	2,96	5,95	12,33	23,32	0,01	0,02
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,42	9,32	2,07	5,81	12,21	24,91	0,59	1,25
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	-3,46	17,23	1,81	7,82	21,85	-5,29		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,57	16,05	1,32	7,00	20,13	-7,28	4,97	10,47
IBOVESPA - BENCHMARK	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03		
SICREDI PETROBRAS FI AÇÕES	7,83	68,32	19,92	76,30	58,37	183,70	10,56	22,25
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,71	6,76	0,19	14,05	4,84	4,66	7,65	16,12
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	0,90	5,40	-1,05	14,24	4,22	1,06	7,77	16,37
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,26	2,02	-1,96	10,30	-0,01	-4,02	7,72	16,25
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,20	-4,19	-2,66	4,48	-1,31	-7,29	5,34	11,24
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-0,56	-2,40	-5,44	9,05	-12,43		9,55	20,12
IBX-50 - BENCHMARK	1,21	4,92	-0,03	13,75	5,32	5,93		
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	0,94	3,70	-1,68	10,78	2,36	0,19	7,84	16,52
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	0,29	8,97	2,05	4,08	11,42	21,35		
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 GERAL - BENCHMARK	0,18	10,59	1,80	6,72	12,50	22,90		

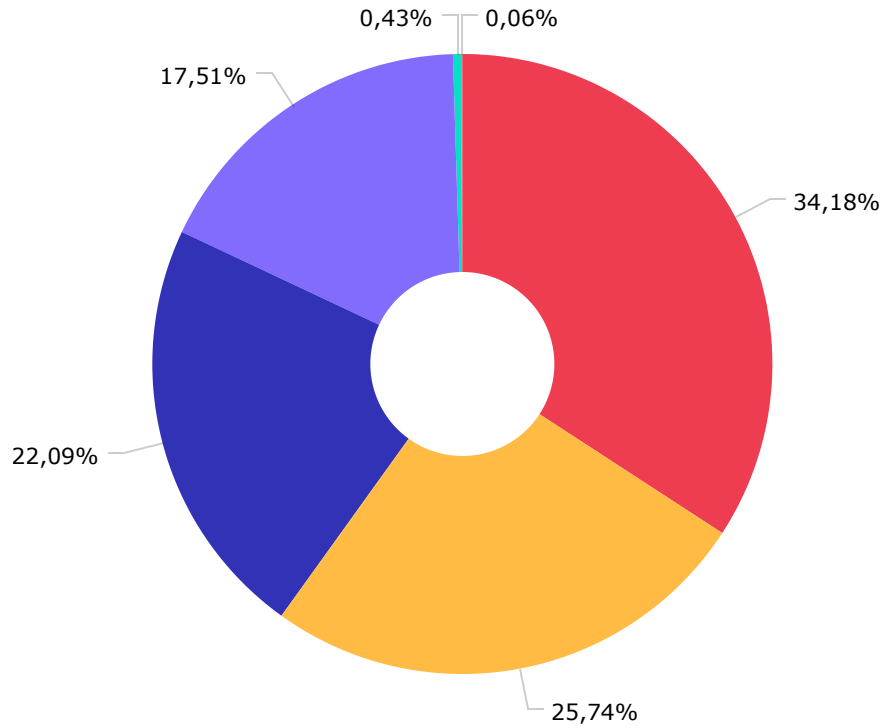
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,96	10,59	-0,57	6,42	10,78	18,56	2,53	5,32
IMA-B - BENCHMARK	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09		
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,97	10,58	-0,66	6,49	10,77	18,43	2,54	5,34
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88		
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		
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	-0,59	-5,09	-1,76	-3,45	-7,00	-13,11		
IRF-M - BENCHMARK	0,17	11,62	1,83	7,45	13,57	22,67		
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	0,14	11,64	1,85	7,40	13,34	23,43	1,23	2,60
IRF-M 1 - BENCHMARK	0,93	10,06	3,18	6,50	13,54	24,68		
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,93	10,18	3,26	6,64	13,64	25,17	0,10	0,22
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	-4,87	11,68	-3,65	4,35	19,59	-0,45		
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,42	18,22	-1,80	8,52	29,82	17,99	4,84	10,19
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-4,44	17,78	-1,90	8,26	29,28	17,25	5,01	10,55







BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	13.020.769,95
CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ...	9.804.732,82
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	8.414.755,17
ITAU UNIBANCO S.A.	6.670.776,95
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.	162.416,54
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	22.596,19



BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	13.020.769,95
BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	9.804.732,82
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	8.414.755,17
ITAU UNIBANCO S.A.	6.670.776,95
RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL...	162.416,54
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	22.596,19

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%
Março	34.116.071,86	8.630.279,73	8.204.194,10	34.964.111,45	421.953,96	872.321,02	1,22% ▲	2,61%	1,15%	3,32%	78,61%	1,19%
Abril	34.964.111,45	1.462.919,22	1.181.759,11	35.628.440,29	383.168,73	1.255.489,75	1,09% ▲	3,73%	0,95%	4,31%	86,54%	1,23%
Mai	35.628.440,29	608.682,81	814.370,95	36.007.041,16	584.289,01	1.839.778,76	1,64% ▲	5,43%	0,65%	4,99%	108,82%	1,11%
Junho	36.007.041,16	482.284,22	593.627,73	36.584.796,10	689.098,45	2.528.877,21	1,91% ▲	7,45%	0,32%	5,32%	140,04%	1,16%
Julho	36.584.796,10	558.381,17	554.621,89	37.046.520,61	457.965,23	2.986.842,44	1,25% ▲	8,79%	0,52%	5,87%	149,74%	1,08%
Agosto	37.046.520,61	546.245,63	513.626,97	37.190.231,32	111.092,05	3.097.934,49	0,30% ▲	9,12%	0,67%	6,58%	138,60%	1,08%
Setembro	37.190.231,32	1.259.083,51	539.141,54	38.073.451,43	163.278,14	3.261.212,63	0,43% ▲	9,59%	0,64%	7,26%	132,09%	1,19%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	872.321,02	2,61%	3,32%
2º Trim	1.656.556,19	4,71%	1,93%
1º Sem	2.528.877,21	7,45%	5,32%
3º Trim	732.335,42	1,99%	1,84%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

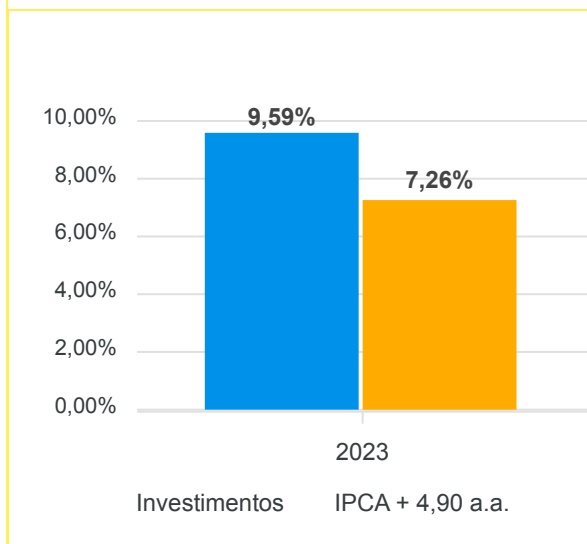


Gráfico Risco x Retorno

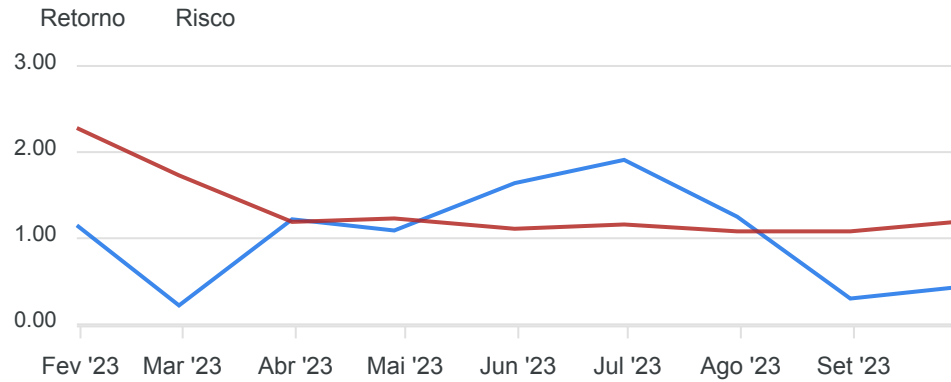
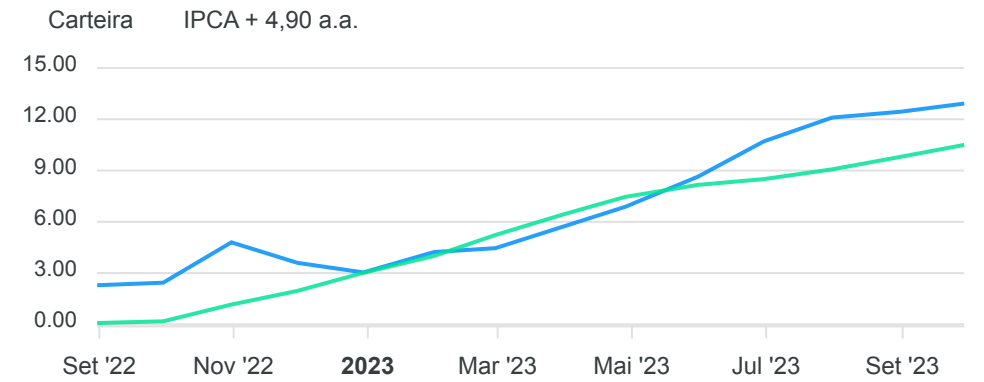
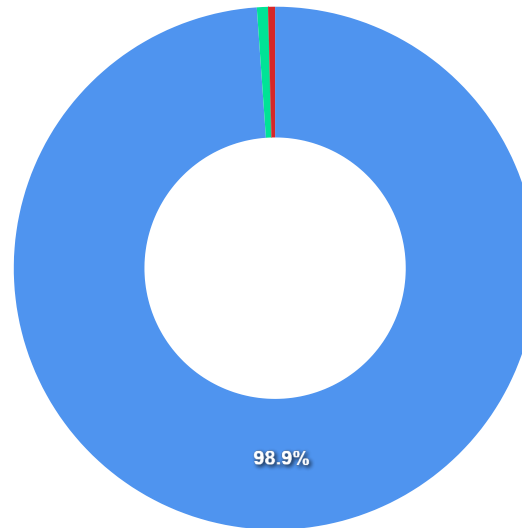


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 29/09/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	37.670.294,37	98,94
Até D+180	263.336,71	0,69
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	162.416,54	0,43



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.794.580,24	476.117,85	539.141,54	1.749.731,04	18.174,49	0,80% ▲	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.239.293,64	0,00	0,00	1.241.917,24	2.623,60	0,21% ▲	0,85%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	773.394,05	0,00	0,00	758.269,69	-15.124,36	-1,96% ▼	4,04%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.523.760,71	0,00	0,00	2.499.189,91	-24.570,80	-0,97% ▼	2,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.806.893,39	0,00	0,00	4.853.519,39	46.626,00	0,97% ▲	0,01%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	6.824.609,92	782.965,66	0,00	7.674.650,68	67.075,10	0,88% ▲	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	3.485.305,12	0,00	0,00	3.499.874,16	14.569,04	0,42% ▲	0,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.680.781,98	0,00	0,00	1.664.652,31	-16.129,67	-0,96% ▼	2,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	654.511,80	0,00	0,00	659.496,04	4.984,24	0,76% ▲	0,24%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1.299.073,22	0,00	0,00	1.311.151,85	12.078,63	0,93% ▲	0,10%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	594.983,76	0,00	0,00	595.814,89	831,13	0,14% ▲	1,23%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.034.569,49	0,00	0,00	6.094.406,36	59.836,87	0,99% ▲	0,02%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	1.510.205,82	0,00	0,00	1.525.070,55	14.864,73	0,98% ▲	0,02%
	33.221.963,14	1.259.083,51	539.141,54	34.127.744,11	185.839,00	0,55%	0,53%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	404.426,99	0,00	0,00	407.304,12	2.877,13	0,71% ▲	7,65%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	262.656,24	0,00	0,00	263.336,71	680,47	0,26% ▲	7,72%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.236.347,54	0,00	0,00	1.247.501,85	11.154,31	0,90% ▲	7,77%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	220.052,00	0,00	0,00	222.113,24	2.061,24	0,94% ▲	7,84%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	166.491,62	0,00	0,00	166.153,97	-337,65	-0,20% ▼	5,34%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	464.423,47	0,00	0,00	461.826,80	-2.596,67	-0,56% ▼	9,55%
SICREDI PETROBRAS FI AÇÕES	53.198,88	0,00	0,00	57.366,53	4.167,65	7,83% ▲	10,56%
-	2.807.596,74	0,00	0,00	2.825.603,22	18.006,48	0,64%	7,96%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	163.383,84	0,00	0,00	162.416,54	-967,30	-0,59% ▼	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	228.942,61	0,00	0,00	218.773,67	-10.168,94	-4,44% ▼	5,01%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	231.149,62	0,00	0,00	220.922,64	-10.226,98	-4,42% ▼	4,84%
-	623.476,07	0,00	0,00	602.112,85	-21.363,22	-3,43%	3,60%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	537.195,37	0,00	0,00	517.991,25	-19.204,12	-3,57% ▼	4,97%
	537.195,37	0,00	0,00	517.991,25	-19.204,12	-3,57%	0,00%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.719.228,02	1.580.744,65	1.607.390,40	1.749.731,04	57.148,77	1,73% ▲
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.218.703,54	0,00	0,00	1.241.917,24	23.213,70	1,90% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	778.119,01	0,00	0,00	758.269,69	-19.849,32	-2,55% ▼
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.515.897,40	0,00	0,00	2.499.189,91	-16.707,49	-0,66% ▼
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.701.950,03	0,00	0,00	4.853.519,39	151.569,36	3,22% ▲
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	6.678.867,70	782.965,66	0,00	7.674.650,68	212.817,32	2,85% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	3.428.805,50	0,00	0,00	3.499.874,16	71.068,66	2,07% ▲
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.674.230,44	0,00	0,00	1.664.652,31	-9.578,13	-0,57% ▼
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	640.833,21	0,00	0,00	659.496,04	18.662,83	2,91% ▲
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1.269.719,42	0,00	0,00	1.311.151,85	41.432,43	3,26% ▲
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	584.976,59	0,00	0,00	595.814,89	10.838,30	1,85% ▲
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.902.838,71	0,00	0,00	6.094.406,36	191.567,65	3,25% ▲
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	1.477.392,44	0,00	0,00	1.525.070,55	47.678,11	3,23% ▲
	32.591.562,01	2.363.710,31	1.607.390,40	34.127.744,11	779.862,19	2,34%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	406.540,03	0,00	0,00	407.304,12	764,09	0,19% ▲
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	268.598,34	0,00	0,00	263.336,71	-5.261,63	-1,96% ▼
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.260.711,01	0,00	0,00	1.247.501,85	-13.209,16	-1,05% ▼
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	225.904,60	0,00	0,00	222.113,24	-3.791,36	-1,68% ▼
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	170.697,27	0,00	0,00	166.153,97	-4.543,30	-2,66% ▼
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	488.382,39	0,00	0,00	461.826,80	-26.555,59	-5,44% ▼
SICREDI PETROBRAS FI AÇÕES	47.836,64	0,00	0,00	57.366,53	9.529,89	19,92% ▲
	2.868.670,28	0,00	0,00	2.825.603,22	-43.067,06	-1,50%

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	165.364,52	0,00	0,00	162.416,54	-2.947,98	-1,78% ▼
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	223.015,57	0,00	0,00	218.773,67	-4.241,90	-1,90% ▼
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	224.963,08	0,00	0,00	220.922,64	-4.040,44	-1,80% ▼
	613.343,17	0,00	0,00	602.112,85	-11.230,32	-1,83%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	511.220,64	0,00	0,00	517.991,25	6.770,61	1,32% ▲
	511.220,64	0,00	0,00	517.991,25	6.770,61	1,32%

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

