

2023

Relatório Mensal

Janeiro

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 3.3, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	733.326,35	2,39%	6.574.841.764,48	0,01%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.506.958,16	14,68%	7.184.164.479,15	0,06%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	91.385,59	0,30%	5.664.338.306,58	0,00%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.548.856,51	8,30%	817.104.956,67	0,31%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	940.835,57	3,06%	5.926.967.108,44	0,02%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.216.974,43	3,96%	3.963.755.899,38	0,03%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.155.611,50	10,28%	2.846.054.203,16	0,11%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.261.249,22	7,36%	5.210.677.767,90	0,04%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.551.260,04	5,05%	1.032.465.427,68	0,15%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	332.192,27	1,08%	1.019.210.632,83	0,03%	7º I b
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	439.924,34	1,43%	808.547.889,80	0,05%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	294.997,23	0,96%	12.971.898.325,20	0,00%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	549.009,57	1,79%	121.792.604,35	0,45%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.808.821,05	12,40%	1.409.888.691,45	0,27%	7º III a
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.279.597,51	7,42%	600.741.669,30	0,38%	8º I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.076.795,40	6,76%	309.497.763,02	0,67%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.027.884,01	3,35%	488.009.000,20	0,21%	8º I
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	250.903,79	0,82%	93.540.500,60	0,27%	8º I
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.126.146,96	3,67%	115.004.325,52	0,98%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.517.320,73	4,94%	1.979.769.025,50	0,08%	9º III

Investimentos

\$ 30.710.050,23

Disponibilidades Financeiras

\$ 228.185,47

Total Carteira

\$ 30.938.235,70

Governança (Pró Gestão)

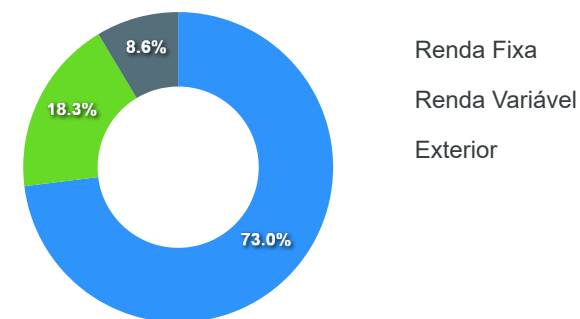
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	57,46%	17.778.573,98 42,54%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	15,04%	4.652.827,85 44,96%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	18,21%	5.635.180,71 11,79%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	8,54%	2.643.467,69 1,46%

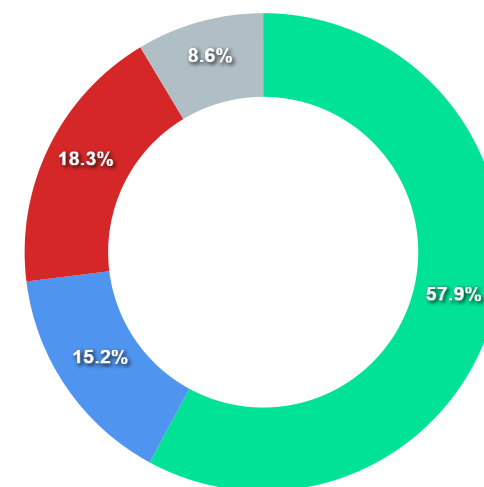
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



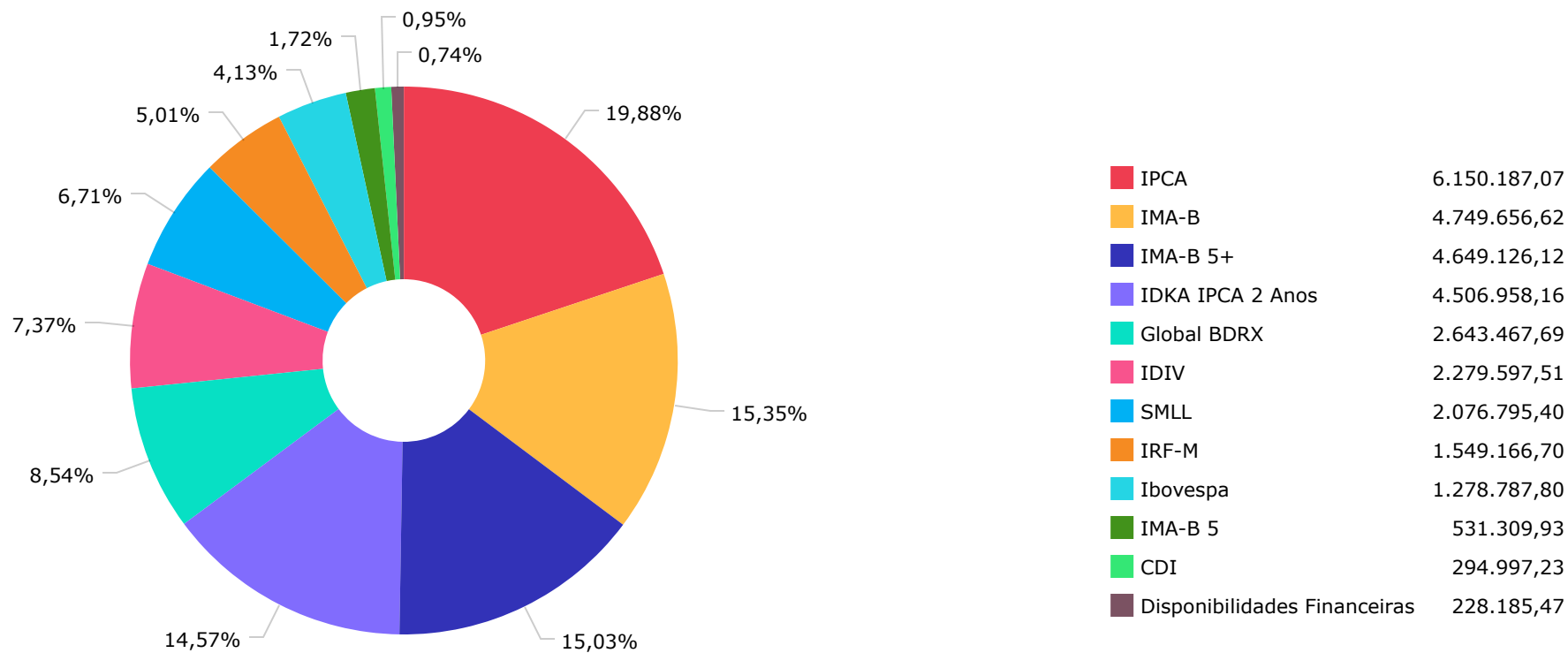
Artigos

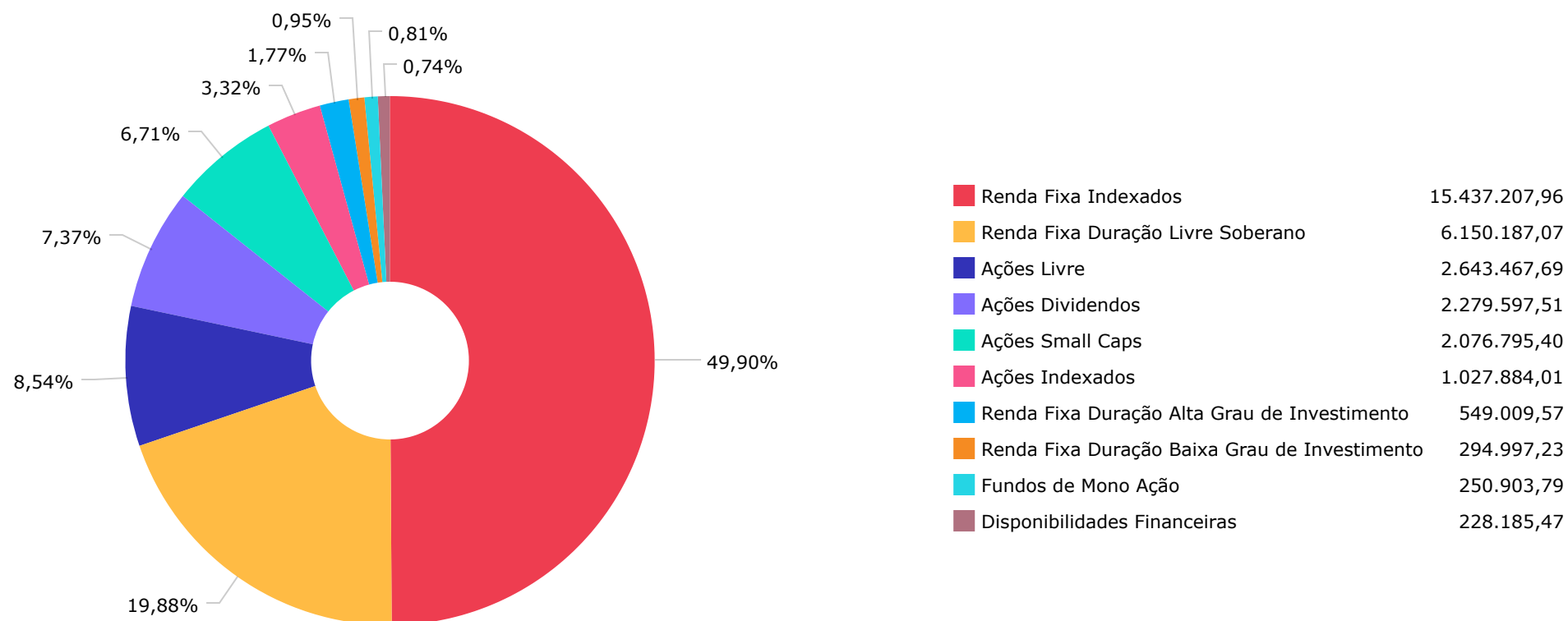


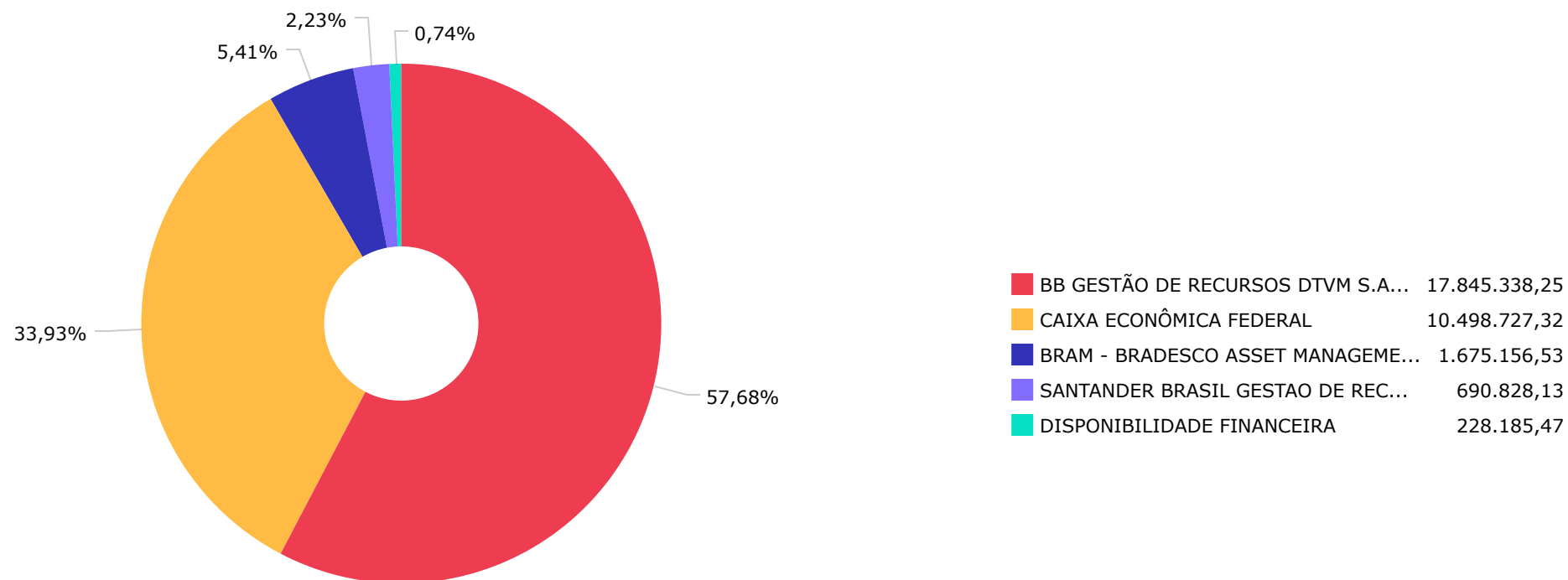
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior	Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	30.938.235,70	8º I - Fundos de Ações	18,21%	0,00%	19,00%	30,00%	3.646.290,00
7º I b - FI 100% Títulos TN	57,46%	0,00%	50,00%	100,00%	13.159.661,72	8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	9.281.470,71
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	30.938.235,70	9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.093.823,57
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.546.911,79	9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.093.823,57
7º III a - FI Referenciados RF	15,04%	0,00%	15,00%	60,00%	13.910.113,57	9º III - Ações - BDR Nível I	8,54%	0,00%	9,00%	10,00%	450.355,88
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	18.562.941,42	10º I - Fundos Multimercados	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	3.093.823,57
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	6.187.647,14	10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.546.911,79
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.546.911,79	10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.546.911,79
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.546.911,79	11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.546.911,79
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.546.911,79	12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.546.911,79

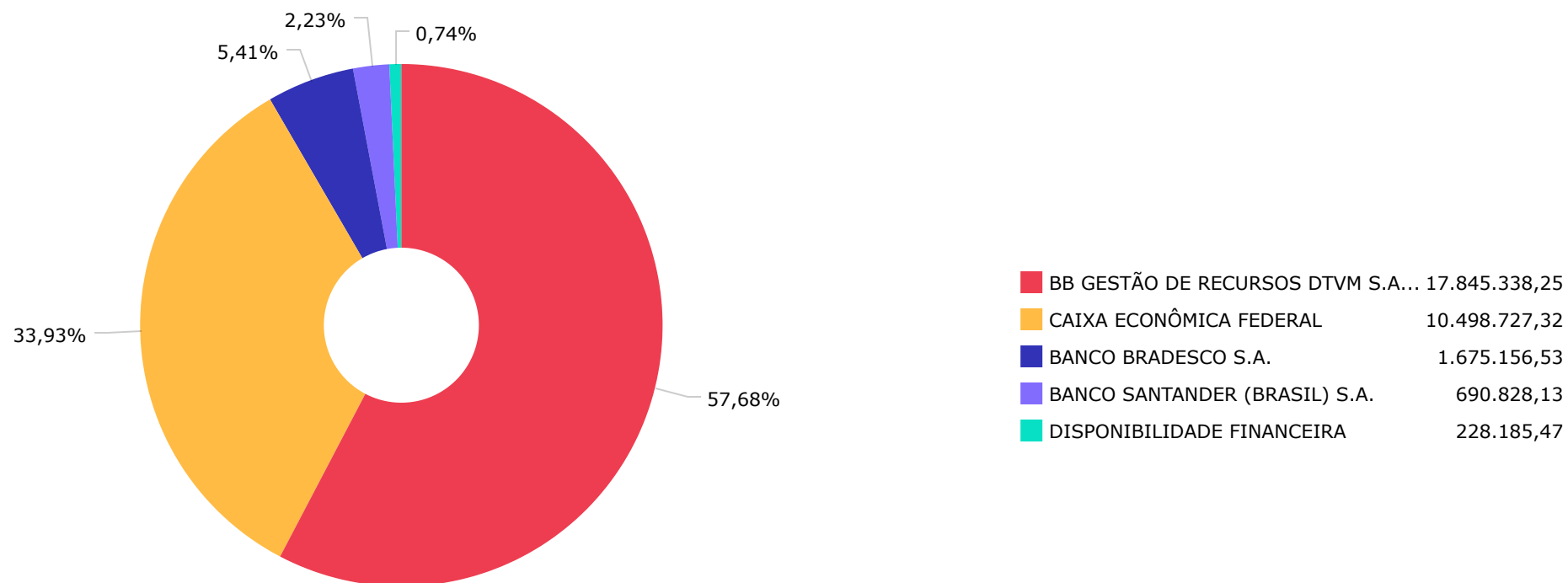
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45		
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,12	1,12	3,30	6,77	12,97	18,92	0,01	0,03
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	4,37	4,37	7,06	-3,63	-16,72	-5,42		
BRANCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,79	1,79	2,08	-4,18	-15,19	-1,59	8,22	17,31
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,32	4,32	6,18	-4,25	-17,40	-8,03	8,80	18,52
IBOVESPA - BENCHMARK	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42		
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	4,72	4,72	-0,82	5,23	31,83	100,63	19,51	41,08
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	3,30	3,30	-2,11	9,99	1,37	-1,47	10,30	21,68
IDIV - BENCHMARK	5,89	5,89	5,00	11,84	10,99	17,61		
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3,72	3,72	-3,07	7,64	2,92	-2,16	9,16	19,29
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	1,44	1,44	1,90	3,99	10,86	16,26		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,44	1,44	2,00	4,40	10,88	15,84	1,15	2,43
IMA-B - BENCHMARK	0,00	0,00	-0,99	2,84	7,15	5,93		
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01	-0,01	-1,03	2,70	6,90	5,39	2,90	6,11
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,09	-0,09	-1,23	2,56	6,74	5,27	3,00	6,33
IMA-B 5 - BENCHMARK	1,40	1,40	2,01	4,40	11,19	16,27		
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,38	1,38	1,96	4,30	10,97	15,81	1,14	2,40
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,37	1,37	1,92	4,27	10,93	15,65	1,15	2,42
IMA-B 5+ - BENCHMARK	-1,26	-1,26	-3,59	1,84	3,66	-3,05		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,28	-1,28	-3,66	1,74	3,41	-3,75	4,62	9,74

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,26	-1,26	-3,65	1,68	3,33	-3,61	4,61	9,70
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,28	-1,28	-3,64	1,71	3,29	-3,88	4,66	9,81
IPCA - BENCHMARK	0,53	0,53	1,57	1,50	5,77	16,75		
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,04	1,04	2,28	6,11	11,10	11,70	0,39	0,81
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,39	1,39	2,20	4,46	10,57		0,93	1,96
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65	0,65	1,30	4,80	9,80	11,11	1,44	3,04
IRF-M - BENCHMARK	0,84	0,84	1,65	6,17	9,82	8,42		
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88	0,88	1,70	6,18	9,76	8,12	1,83	3,85
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82	0,82	1,56	6,01	9,61	7,83	1,86	3,92
SMLL - BENCHMARK	2,92	2,92	-11,39	3,51	-15,47	-24,13		
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2,80	2,80	-12,25	2,63	-17,11	-27,26	12,94	27,25



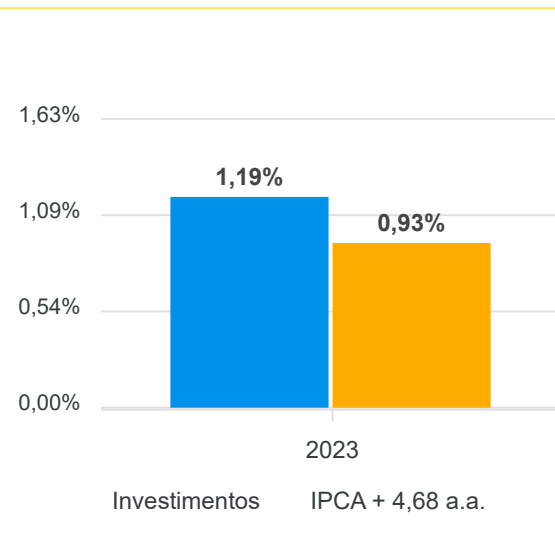






Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	30.350.140,81	0,00	0,00	30.710.050,23	359.909,42	359.909,42	1,19% ▲	1,19%	0,93%	0,93%	127,96%	4,40%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado



Gráficos

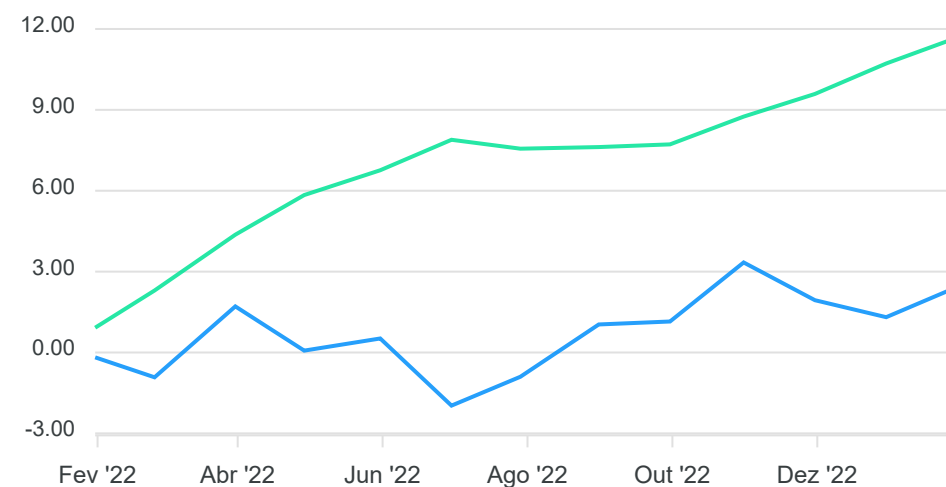
Gráfico Risco x Retorno

Retorno Risco



Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade

Carteira IPCA + 4,68 a.a.



RENTA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	728.607,48	0,00	0,00	733.326,35	4.718,87	0,65% ▲	1,44%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.443.144,46	0,00	0,00	4.506.958,16	63.813,70	1,44% ▲	1,15%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	90.146,32	0,00	0,00	91.385,59	1.239,27	1,37% ▲	1,15%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.581.444,51	0,00	0,00	2.548.856,51	-32.588,00	-1,26% ▼	4,61%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	940.934,48	0,00	0,00	940.835,57	-98,91	-0,01% ▼	2,90%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.207.114,64	0,00	0,00	1.216.974,43	9.859,79	0,82% ▲	1,86%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	291.718,95	0,00	0,00	294.997,23	3.278,28	1,12% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.112.427,44	0,00	0,00	3.155.611,50	43.184,06	1,39% ▲	0,93%
BRANDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	556.110,62	0,00	0,00	549.009,57	-7.101,05	-1,28% ▼	4,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.238.066,28	0,00	0,00	2.261.249,22	23.182,94	1,04% ▲	0,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.571.328,61	0,00	0,00	1.551.260,04	-20.068,57	-1,28% ▼	4,62%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	329.294,62	0,00	0,00	332.192,27	2.897,65	0,88% ▲	1,83%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.812.278,67	0,00	0,00	3.808.821,05	-3.457,62	-0,09% ▼	3,00%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	433.951,83	0,00	0,00	439.924,34	5.972,51	1,38% ▲	1,14%
	22.336.568,91	0,00	0,00	22.431.401,83	94.832,92	0,42%	2,19%

RENTA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.197.818,69	0,00	0,00	2.279.597,51	81.778,82	3,72% ▲	9,16%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.020.160,96	0,00	0,00	2.076.795,40	56.634,44	2,80% ▲	12,94%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	995.095,27	0,00	0,00	1.027.884,01	32.788,74	3,30% ▲	10,30%
SANTANDER PETROBRAS 2 FIC AÇÕES	239.590,06	0,00	0,00	250.903,79	11.313,73	4,72% ▲	19,51%
-	5.452.664,98	0,00	0,00	5.635.180,71	182.515,73	3,35%	11,22%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BRABESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.106.383,84	0,00	0,00	1.126.146,96	19.763,12	1,79% ▲	8,22%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.454.523,08	0,00	0,00	1.517.320,73	62.797,65	4,32% ▲	8,80%
	2.560.906,92	0,00	0,00	2.643.467,69	82.560,77	3,22%	3,50%

