2023 Relatório Mensal

Agosto 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 Nivel I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R$	% PL	Lei
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.391.277,70	2,52%	5.967.981.074,09	0,16%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.396.659,96	1,45%	6.160.923.946,07	0,09%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.422.339,94	0,38%	5.260.991.740,78	0,03%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.746.184,71	3,42%	6.785.029.538,03	0,19%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	855.411,00	0,23%	3.281.620.346,76	0,03%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.460.797,58	5,49%	2.413.618.165,51	0,85%	7º I b
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.272.740,33	3,02%	667.857.891,98	1,69%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.501.273,67	2,82%	1.741.190.321,28	0,60%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.699.414,56	0,72%	5.643.739.686,42	0,05%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.666.763,98	7,96%	5.504.316.744,32	0,54%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	61.800.631,97	16,57%	8.195.443.440,71	0,75%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.231.865,42	1,94%	1.532.125.808,15	0,47%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	502.952,34	0,13%	5.279.029.725,18	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.099.678,04	0,83%	584.356.222,54	0,53%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	73.754.908,95	19,78%	7.477.458.112,25	0,99%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	68.884,34	0,02%	1.608.678.980,95	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	21.903.152,17	5,87%	2.203.872.085,49	0,99%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	465.307,53	0,12%	323.559.549,93	0,14%	7º I b
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	752.326,42	0,20%	953.178.073,80	0,08%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	29.220.550,75	7,84%	14.734.335.445,36	0,20%	7º III a
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.633.355,27	1,24%	717.340.385,64	0,65%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	476.002,45	0,13%	980.045.918,76	0,05%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	24.547.841,02	6,58%	9.013.672.474,30	0,27%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	985.671,42	0,26%	1.389.232.597,65	0,07%	7º III a
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1.565.993,38	0,42%	319.000.388,50	0,49%	7º III a
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.397.744,00	1,98%	225.557.887,64	3,28%	7º V b
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	531.308,12	0,14%	215.380.530,11	0,25%	8º I

Investimentos

$ 372.863.918,79

Disponibilidades Financeiras

$ 174.749,17

Total Carteira

$ 373.038.667,96

Governança (Pró Gestão)

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R$	% PL	Lei
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	222.723,95	0,06%	573.674.597,27	0,04%	8º I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	204.579,60	0,05%	452.902.777,24	0,05%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.763.247,57	1,01%	1.703.057.937,88	0,22%	8º I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.977.369,21	0,53%	339.245.644,00	0,58%	8º I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	549.579,91	0,15%	334.604.963,17	0,16%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.600.887,49	0,97%	468.217.504,61	0,77%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.042.635,48	2,16%	2.114.296.555,90	0,38%	9º III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	423.049,22	0,11%	83.657.155,59	0,51%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	9.880.487,35	2,65%	1.203.059.018,22	0,82%	10º I
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	282.765,23	0,08%	159.450.474,26	0,18%	10º I
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	565.556,76	0,15%	250.314.112,60	0,23%	NE

Investimentos

$ 372.863.918,79

Disponibilidades Financeiras

$ 174.749,17

Total Carteira

$ 373.038.667,96

Governança (Pró Gestão)

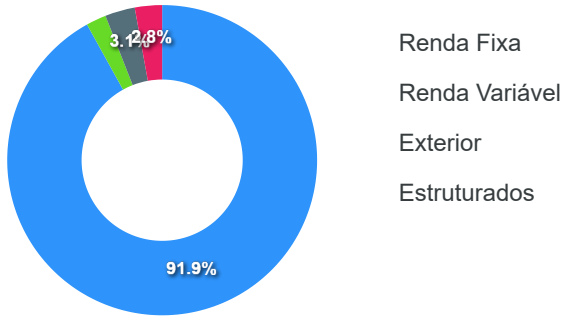
Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

Artigos	Limite (%)		Utilizado		Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	73,25%	273.240.244,19	26,75%	99.798.423,77
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	16,67%	62.181.740,71	43,33%	161.641.460,07
7º V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	1,98%	7.397.744,00	3,02%	11.254.189,40
8º I - Fundos de Ações	30,00%	1,94%	7.248.808,36	28,06%	104.662.792,03
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,12%	11.643.522,97	6,88%	25.660.343,83
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	2,84%	10.586.301,80	7,16%	26.717.565,00
Não Enquadrado	0,00%	0,15%	565.556,76	-0,15%	-565.556,76

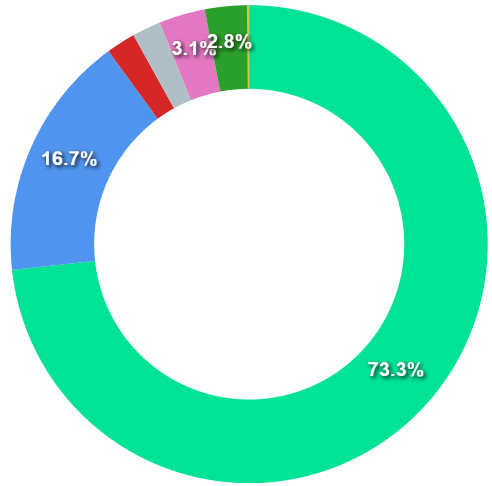
Governança (Pró Gestão)

Não possui

Segmentos



Artigos



Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7º I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	40,00%	100,00%	373.038.667,96
7º I b - FI 100% Títulos TN	73,25%	0,00%	23,00%	100,00%	99.798.423,77
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	373.038.667,96
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.651.933,40
7º III a - FI Referenciados RF	16,67%	0,00%	24,00%	60,00%	161.641.460,07
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	223.823.200,78
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	74.607.733,59
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.651.933,40
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	1,98%	0,00%	2,00%	5,00%	11.254.189,40
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.651.933,40

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	1,94%	0,00%	4,00%	30,00%	104.662.792,03
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	111.911.600,39
9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	37.303.866,80
9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	37.303.866,80
9º III - Ações - BDR Nível I	3,12%	0,00%	3,00%	10,00%	25.660.343,83
10º I - Fundos Multimercados	2,84%	0,00%	3,00%	10,00%	26.717.565,00
10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.651.933,40
10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.651.933,40
11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.651.933,40
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.651.933,40
Não Enquadrado	0,15%	0,00%	0,00%	0,00%	-565.556,76

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
NÃO DEFINIDO - BENCHMARK								
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,94		0,04				4,45	9,38
CDI - BENCHMARK	**1,14**	**8,87**	**3,32**	**6,68**	**13,55**	**25,14**		
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1,11	9,08	3,57	7,11	13,61	25,84	0,18	0,38
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,16	8,81	3,35	6,69	13,54	25,45	0,02	0,04
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,67	6,38	1,85	3,57	7,86	18,63	1,78	3,76
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,67	6,38	1,85	3,57	7,86	18,63	1,78	3,76
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	**3,26**	**21,43**	**5,97**	**15,02**	**15,64**	**-2,06**		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,90	20,35	5,57	14,51	14,97	-4,08	8,36	17,60
IBOVESPA - BENCHMARK	**-5,09**	**5,47**	**6,84**	**10,30**	**5,68**	**-2,56**		
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,09	34,32	9,12	27,21	17,54	-19,97	8,23	17,34
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	-5,14	4,72	6,49	9,64	4,60	-4,92	6,30	13,26
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,70	9,12	4,63	11,06	3,31	16,03	4,96	10,45
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	-4,23	8,60	4,64	11,31	2,29	7,73	5,08	10,69
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-6,32	1,51	3,86	5,57	-0,80	-8,82	6,59	13,88
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,95	-3,99	2,67	0,58	-2,10	-13,16	4,56	9,60
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-8,94	-1,06	2,60	4,42	-11,97	-29,02	7,75	16,32
IDIV - BENCHMARK	**-2,83**	**9,22**	**8,71**	**11,58**	**10,64**	**15,38**		
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-5,09	4,73	6,54	8,82	4,16	6,28	6,15	12,95
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	**0,77**	**8,66**	**2,75**	**5,42**	**11,80**	**22,33**		
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74	8,36	2,73	5,26	11,57	21,91	0,92	1,93
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77	8,41	2,76	5,32	11,53	21,66	0,90	1,91

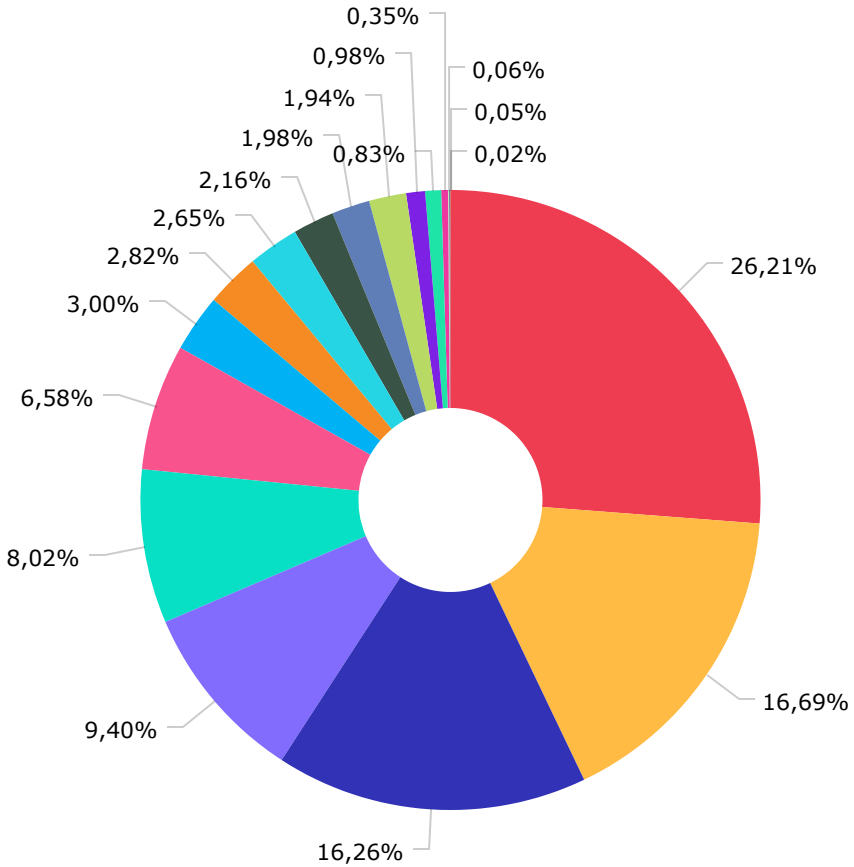
Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
IMA GERAL - BENCHMARK	**0,63**	**10,39**	**3,38**	**8,50**	**13,72**	**22,67**		
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59	10,37	3,26	8,51	13,77	22,36	0,75	1,57
IMA-B - BENCHMARK	**-0,38**	**11,84**	**2,83**	**10,43**	**13,76**	**20,07**		
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,37	11,72	2,79	10,37	13,51	19,64	1,71	3,61
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,45	11,66	2,71	10,33	13,48	19,44	1,77	3,73
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,34	11,82	2,86	10,57	13,46	19,55	1,75	3,69
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40	11,65	2,71	10,26	13,45	19,42	1,74	3,67
IMA-B 5 - BENCHMARK	**0,61**	**8,75**	**2,66**	**5,76**	**11,97**	**23,03**		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,60	8,67	2,60	5,72	11,81	22,71	0,94	1,98
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,58	8,58	2,58	5,65	11,66	22,12	0,91	1,92
IMA-B 5+ - BENCHMARK	**-1,27**	**14,28**	**2,80**	**14,40**	**15,00**	**16,66**		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,26	13,86	2,75	14,04	14,48	15,69	2,62	5,52
IPCA - BENCHMARK	**0,23**	**3,23**	**0,27**	**1,83**	**4,61**	**13,74**		
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,57	11,03	3,48	9,41	14,11	22,38	0,97	2,05
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04	10,75	3,67	8,97	14,02	22,87	0,10	0,22
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,63	9,92	3,67	7,75	13,76	23,41	0,58	1,23
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,37	11,68	3,52	9,87	12,79	24,05	1,25	2,64
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,25	7,47	3,05	8,22	9,38	19,05	1,33	2,79
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91		2,95				0,62	1,31
IRF-M - BENCHMARK	**0,76**	**11,43**	**3,81**	**9,56**	**14,96**	**22,06**		
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72	11,10	3,63	9,30	14,47	21,30	1,05	2,22

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

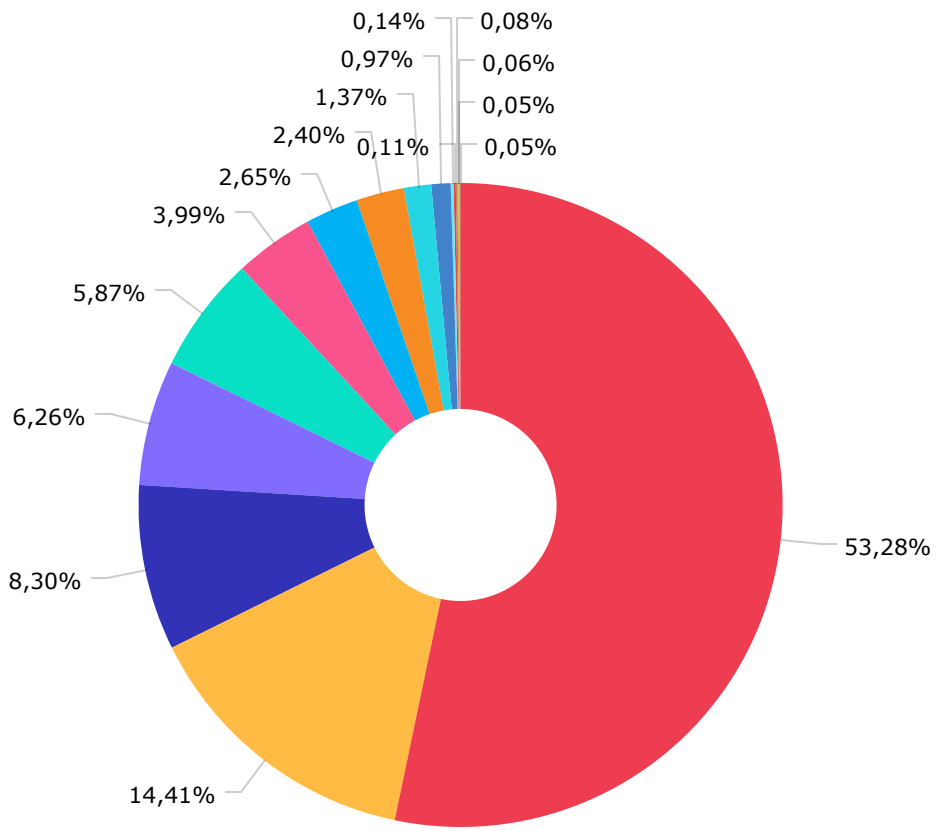
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,16	8,95	3,41	6,72	13,59	23,66	0,18	0,37
IRF-M 1 - BENCHMARK	**1,15**	**9,05**	**3,44**	**6,81**	**13,74**	**24,03**		
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,14	8,91	3,39	6,70	13,52	23,54	0,18	0,37
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11	8,92	3,38	6,69	13,51	23,50	0,18	0,37
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12	8,82	3,37	6,66	13,40	23,37	0,18	0,37
IRF-M 1+ - BENCHMARK	**0,59**	**12,99**	**4,10**	**11,31**	**16,04**	**21,61**		
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,55	12,75	4,03	11,11	15,53	20,69	1,47	3,10
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	**-1,77**	**17,40**	**7,84**	**13,54**	**13,97**	**-0,33**		
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-0,95	23,26	9,83	17,85	23,63	17,05	5,70	12,00
SELIC - BENCHMARK	**1,14**	**8,87**	**3,32**	**6,68**	**13,55**	**25,14**		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,27	9,16	3,63	7,00	14,06	26,49	0,02	0,04
IPCA + 6,00% AO ANO - BENCHMARK	**0,76**	**7,32**	**1,74**	**4,84**	**10,88**	**27,80**		
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,93	9,15	3,13	6,21	12,36	23,15	1,01	2,12

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777



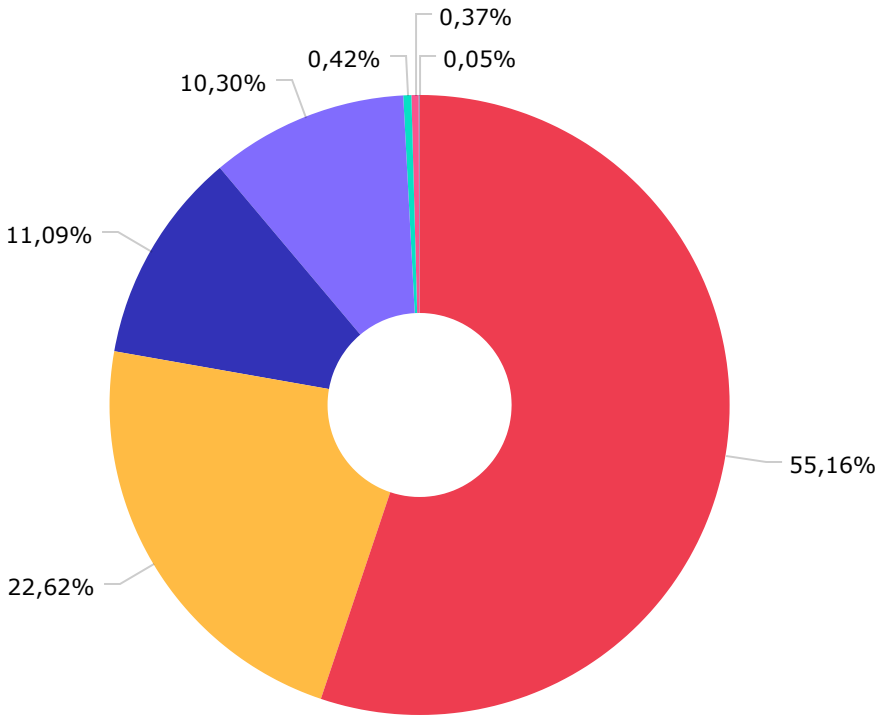
IRF-M 1	97.773.833,99
IMA-B 5	62.276.634,42
IPCA	60.653.990,66
IDKA IPCA 2 Anos	35.063.423,94
CDI	29.926.365,20
Selic	24.547.841,02
Ibovespa	11.192.528,66
Não definido	10.501.273,67
S&P 500 (Moeda Original)	9.880.487,35
Global BDRX	8.042.635,48
IPCA + 6,00% ao ano	7.397.744,00
IMA-B 5+	7.231.865,42
IMA-B	3.663.290,12
IMA Geral	3.099.678,04
IRF-M	1.320.718,53
IDIV	222.723,95
Disponibilidades Financeiras	174.749,17
IRF-M 1+	68.884,34

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777



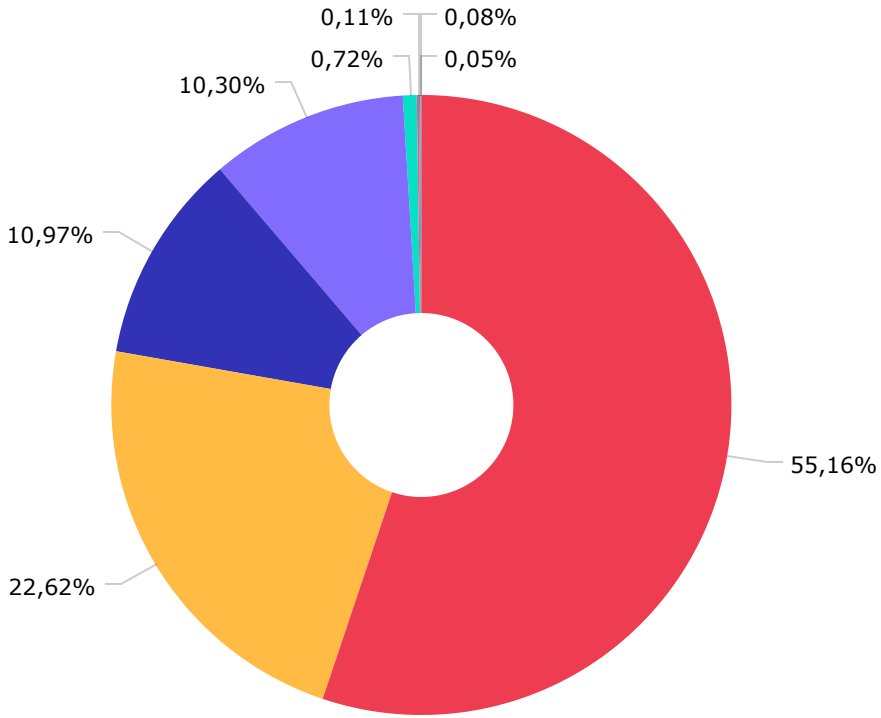
Renda Fixa Indexados	198.749.586,02
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	53.768.391,77
Não classificado	30.962.071,25
Renda Fixa Duração Livre Soberano	23.363.432,59
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	21.903.152,17
Ações Livre	14.898.388,93
Multimercados Estratégia Específica	9.880.487,35
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	8.963.737,38
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	5.109.357,72
Ações Setoriais	3.600.887,49
Ações Indexados	531.308,12
Multimercados Juros e Moedas	423.049,22
Multimercados Macro	282.765,23
Ações Dividendos	222.723,95
Ações Índice Ativo	204.579,60
Disponibilidades Financeiras	174.749,17

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	205.752.424,17
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	84.377.743,67
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	41.357.242,62
ITAU UNIBANCO S.A.	38.412.613,05
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA...	1.565.993,38
XP GESTAO DE RECURSOS LTDA	1.397.901,90
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	174.749,17

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	205.752.424,17
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	84.377.743,67
BANCO BRADESCO S.A.	40.929.939,07
ITAU UNIBANCO S.A.	38.412.613,05
INTRAG DTVM LTDA	2.681.130,05
BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E...	427.303,55
BNY MELLON SERVIÇOES FINANCEIR...	282.765,23
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	174.749,17

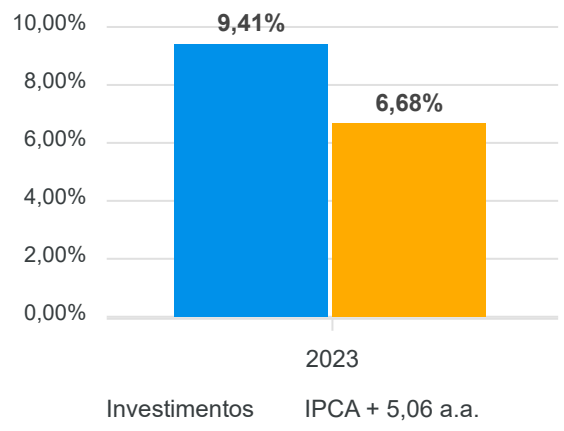
Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno Acumulado $	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	327.395.216,90	46.869,13	1.113.951,52	330.127.002,12	3.798.867,61	3.798.867,61	1,16% ▲	1,16%	0,96%	0,96%	120,83%	1,90%
Fevereiro	330.127.002,12	38.300.410,87	36.096.059,79	335.170.412,23	2.839.059,03	6.637.926,64	0,85% ▲	2,02%	1,20%	2,17%	93,09%	1,40%
Março	335.170.412,23	3.865.293,25	1.253.668,14	342.682.434,66	4.900.397,32	11.538.323,96	1,45% ▲	3,50%	1,16%	3,36%	104,17%	1,19%
Abril	342.682.434,66	3.364.707,27	1.183.675,63	348.044.765,93	3.181.299,63	14.719.623,59	0,92% ▲	4,46%	0,97%	4,36%	102,29%	0,96%
Maio	348.044.765,93	35.487.101,73	33.140.049,41	354.918.236,81	4.526.418,56	19.246.042,15	1,29% ▲	5,81%	0,66%	5,05%	115,05%	0,96%
Junho	354.918.236,81	3.112.629,07	1.626.474,52	361.817.744,76	5.413.353,40	24.659.395,55	1,52% ▲	7,42%	0,33%	5,40%	137,41%	1,02%
Julho	361.817.744,76	3.593.598,93	1.287.065,51	368.340.947,16	4.216.668,98	28.876.064,53	1,16% ▲	8,66%	0,53%	5,96%	145,30%	0,90%
Agosto	368.340.947,16	4.087.053,73	2.133.913,11	372.863.918,79	2.569.831,01	31.445.895,54	0,69% ▲	9,41%	0,68%	6,68%	140,87%	1,18%

Retorno Acululado (Períodos)

Período	Retorno $	Retorno %	Meta %
1º Trim	11.538.323,96	3,50%	3,36%
2º Trim	13.121.071,59	3,78%	1,97%
1º Sem	24.659.395,55	7,42%	5,40%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado



Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

Gráfico Risco x Retorno

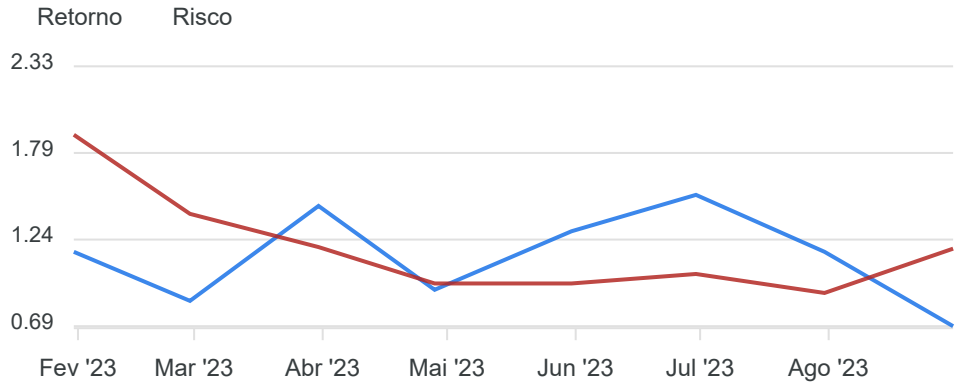
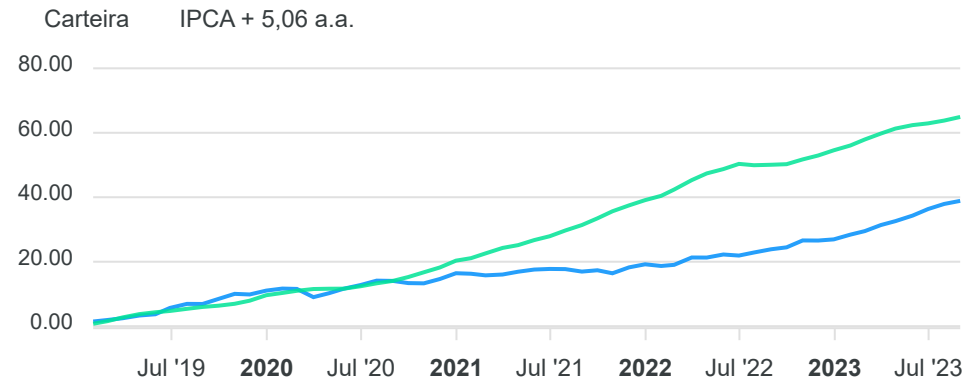
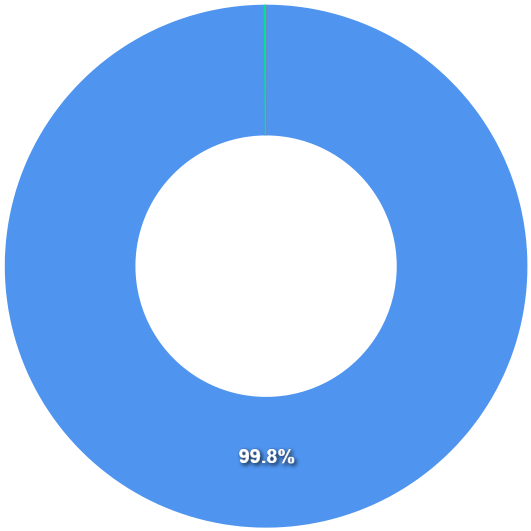


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/08/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	372.473.111,20	99,90
Até D+180	565.556,76	0,15
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	0,00	0,00



Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno %	Risco - VaR
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.294.700,66	0,00	0,00	9.391.277,70	96.577,04	1,04% ▲	0,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.357.058,84	0,00	0,00	5.396.659,96	39.601,12	0,74% ▲	0,92%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	755.759,17	0,00	0,00	752.326,42	-3.432,75	-0,45% ▼	1,77%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	831.382,11	602.463,88	0,00	1.422.339,94	-11.506,05	-0,80% ▼	1,74%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.605.534,13	0,00	0,00	12.746.184,71	140.650,58	1,12% ▲	0,18%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	849.260,20	0,00	0,00	855.411,00	6.150,80	0,72% ▲	1,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	28.886.883,32	0,00	0,00	29.220.550,75	333.667,43	1,16% ▲	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.874.811,01	0,00	602.463,88	20.460.797,58	188.450,45	0,90% ▲	0,62%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.607.254,24	0,00	0,00	4.633.355,27	26.101,03	0,57% ▲	0,97%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	473.263,46	0,00	0,00	476.002,45	2.738,99	0,58% ▲	0,91%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.145.972,72	0,00	0,00	11.272.740,33	126.767,61	1,14% ▲	0,18%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	24.240.707,76	0,00	0,00	24.547.841,02	307.133,26	1,27% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.708.487,40	0,00	304.098,07	10.501.273,67	96.884,34	0,90% ▲	4,45%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.682.496,16	0,00	0,00	2.699.414,56	16.918,40	0,63% ▲	0,58%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.438.782,48	0,00	0,00	29.666.763,98	227.981,50	0,77% ▲	0,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	61.433.818,06	0,00	0,00	61.800.631,97	366.813,91	0,60% ▲	0,94%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.971.786,54	354.283,54	0,00	7.231.865,42	-94.204,66	-1,29% ▼	2,62%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	504.824,14	0,00	0,00	502.952,34	-1.871,80	-0,37% ▼	1,71%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.081.641,26	0,00	0,00	3.099.678,04	18.036,78	0,59% ▲	0,75%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.329.590,40	0,00	0,00	7.397.744,00	68.153,60	0,93% ▲	1,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	71.039.224,47	3.130.306,31	1.227.351,16	73.754.908,95	812.729,33	1,10% ▲	0,18%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	68.508,87	0,00	0,00	68.884,34	375,47	0,55% ▲	1,47%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	989.083,04	0,00	0,00	985.671,42	-3.411,62	-0,34% ▼	1,75%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	21.822.346,11	0,00	0,00	21.903.152,17	80.806,06	0,37% ▲	1,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	459.976,75	0,00	0,00	465.307,53	5.330,78	1,16% ▲	0,18%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1.562.115,42	0,00	0,00	1.565.993,38	3.877,96	0,25% ▲	1,33%

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno %	Risco - VaR
	338.015.268,72	4.087.053,73	2.133.913,11	342.819.728,90	2.851.319,56	0,84%	0,70%

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno %	Risco - VaR
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	560.077,65	0,00	0,00	531.308,12	-28.769,53	-5,14% ▼	6,30%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	234.668,79	0,00	0,00	222.723,95	-11.944,84	-5,09% ▼	6,15%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	218.380,96	0,00	0,00	204.579,60	-13.801,36	-6,32% ▼	6,59%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.959.113,34	0,00	0,00	3.763.247,57	-195.865,77	-4,95% ▼	4,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.171.417,04	0,00	0,00	1.977.369,21	-194.047,83	-8,94% ▼	7,75%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	590.565,91	0,00	0,00	565.556,76	-25.009,15	-4,23% ▼	5,08%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	570.673,75	0,00	0,00	549.579,91	-21.093,84	-3,70% ▼	4,96%
-	8.304.897,44	0,00	0,00	7.814.365,12	-490.532,32	-5,91%	5,65%

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

ESTRUTURADOS	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno %	Risco - VaR
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	418.417,44	0,00	0,00	423.049,22	4.631,78	1,11% ▲	0,18%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	9.974.798,86	0,00	0,00	9.880.487,35	-94.311,51	-0,95% ▼	5,70%
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	284.659,08	0,00	0,00	282.765,23	-1.893,85	-0,67% ▼	1,78%
-	10.677.875,38	0,00	0,00	10.586.301,80	-91.573,58	-0,86%	5,37%

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.527.215,12	0,00	0,00	3.600.887,49	73.672,37	2,09% ▲	8,23%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.815.690,50	0,00	0,00	8.042.635,48	226.944,98	2,90% ▲	8,36%
	11.342.905,62	0,00	0,00	11.643.522,97	300.617,35	2,65%	2,55%

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

Cenário Econômico

Após uma sequência de meses no positivo, quem possui investimentos em uma carteira diversificada, acabou, provavelmente, fechando a rentabilidade no campo negativo. Na renda fixa, sinais mistos, com a abertura da curva de juros, os fundos atrelados a inflação mais longos fecharam no negativo. Mas os investimentos em títulos públicos e juros mais curtos tiveram rentabilidade positiva. A renda variável local, com o fraco desempenho do Ibovespa, fez com o que os fundos fechassem em forte baixa, e por fim os fundos com investimentos ligados nos ativos no exterior, prejudicado pelos desempenhos ruins das economias globais, fecharam o mês igualmente no negativo. Mas, mesmo com o resultado ruim deste mês, o número não foi suficiente para afetar a rentabilidade positiva no acumulado deste ano, e a maioria dos RPPS seguem com boa folga frente as suas respectivas metas atuariais.

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 mantem 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.

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

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, apesar do realinhamento das taxas de juros no longo prazo provocando rentabilidade não satisfatória nos fundos IMA`s e títulos públicos federais com marcação a mercado, as estratégias de investimentos de menor prazo como em CDI seguem com rentabilidade competitiva. Como já dissemos na análise do cenário econômico, a renda variável local, com o fraco desempenho do Ibovespa, fez com o que os fundos fechassem em baixa, junto com os fundos com investimentos ligados aos ativos no exterior, prejudicados pelos desempenhos ruins das economias globais.

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, 13 de setembro de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777