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 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	9.554.368,99	2,52%	6.082.622.569,66	0,16%	7º I b
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.390.252,19	1,42%	5.824.441.376,72	0,09%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.399.066,50	0,37%	5.052.854.726,15	0,03%	7º I b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.980.289,50	3,42%	7.179.042.508,92	0,18%	7º I b
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	859.632,13	0,23%	3.620.971.555,98	0,02%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.779.060,54	5,48%	2.503.461.334,36	0,83%	7º I b
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.480.869,88	3,03%	719.678.543,43	1,60%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.664.632,51	2,81%	1.801.029.516,58	0,59%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.593.539,64	0,42%	5.136.324.306,86	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.685.479,85	7,83%	5.184.421.071,28	0,57%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	61.670.759,79	16,27%	7.787.487.970,57	0,79%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.029.052,25	1,85%	1.373.230.642,51	0,51%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	494.828,79	0,13%	5.036.600.197,80	0,01%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.113.060,71	0,82%	580.626.961,62	0,54%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	74.404.591,94	19,63%	7.795.296.699,71	0,95%	7º I b
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	68.824,95	0,02%	1.646.050.653,70	0,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	21.792.189,92	5,75%	2.180.749.467,31	1,00%	7º I b
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	473.842,51	0,12%	397.435.163,61	0,12%	7º I b
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	739.948,26	0,20%	906.861.937,86	0,08%	7º III a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	34.860.746,00	9,20%	15.296.039.303,73	0,23%	7º III a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	474.917,02	0,13%	918.763.261,01	0,05%	7º III a
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	31.598.521,39	8,34%	8.965.211.424,43	0,35%	7º III a
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	968.917,57	0,26%	1.238.456.183,31	0,08%	7º III a
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1.549.629,85	0,41%	307.641.899,04	0,50%	7º III a
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.380.313,60	1,95%	219.428.689,69	3,36%	7º V b
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	518.200,51	0,14%	204.707.411,70	0,25%	8º I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.594.612,65	0,95%	1.495.048.092,10	0,24%	8º I

Investimentos
$ 379.085.071,47

Disponibilidades Financeiras
$ 3.077.211,23

Total Carteira
$ 382.162.282,70

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
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.823.394,13	0,48%	306.871.135,96	0,59%	8º I
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	556.408,72	0,15%	230.048.887,86	0,24%	8º I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	531.927,84	0,14%	318.639.153,87	0,17%	8º I
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.415.663,45	0,90%	429.910.854,12	0,79%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.646.614,60	2,02%	1.935.277.303,73	0,40%	9º III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	430.975,20	0,11%	86.299.580,69	0,50%	10º I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	9.276.642,39	2,45%	1.128.762.122,57	0,82%	10º I
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	283.295,70	0,07%	137.506.845,22	0,21%	10º I

Investimentos

$ 379.085.071,47

Disponibilidades Financeiras

$ 3.077.211,23

Total Carteira

$ 382.162.282,70

Governança (Pró Gestão)

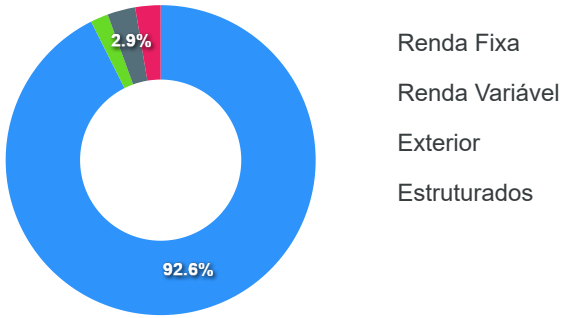
Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

Artigos	Limite (%)		Utilizado		Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	71,55%	273.434.342,59	28,45%	108.727.940,11
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	18,37%	70.192.680,09	41,63%	159.104.689,53
7º V b - Fundos de RF - Crédito Privado	5,00%	1,93%	7.380.313,60	3,07%	11.727.800,54
8º I - Fundos de Ações	30,00%	1,84%	7.024.543,85	28,16%	107.624.140,96
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	2,89%	11.062.278,05	7,11%	27.153.950,22
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	2,61%	9.990.913,29	7,39%	28.225.314,98

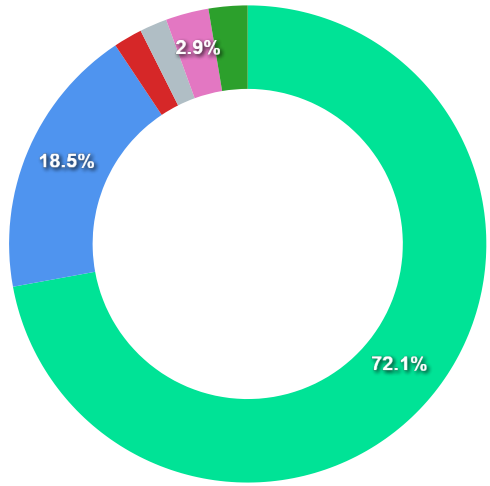
Governança (Pró Gestão)

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%	382.162.282,70
7º I b - FI 100% Títulos TN	71,55%	0,00%	23,00%	100,00%	108.727.940,11
7º I c - ETF 100% Títulos TN	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	382.162.282,70
7º II - Operações Compromissad...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	19.108.114,14
7º III a - FI Referenciados RF	18,37%	0,00%	24,00%	60,00%	159.104.689,53
7º III b - FI de Índices Refer...	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	229.297.369,62
7º IV - Ativos Financeiros de ...	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	76.432.456,54
7º V a - FIDC Cota Sênior	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	19.108.114,14
7º V b - Fundos de RF - Crédit...	1,93%	0,00%	2,00%	5,00%	11.727.800,54
7º V c - Fundos de Debentures ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	19.108.114,14

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8º I - Fundos de Ações	1,84%	0,00%	4,00%	30,00%	107.624.140,96
8º II - ETF de Ações	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	114.648.684,81
9º I - Renda Fixa - Dívida Ext...	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	38.216.228,27
9º II - Constituídos no Brasil	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	38.216.228,27
9º III - Ações - BDR Nível I	2,89%	0,00%	3,00%	10,00%	27.153.950,22
10º I - Fundos Multimercados	2,61%	0,00%	3,00%	10,00%	28.225.314,98
10º II - Fundos em Participaçõ...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	19.108.114,14
10º III - Fundos de Ações - Me...	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	19.108.114,14
11º - Fundos Imobiliários	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	19.108.114,14
12º - Empréstimos Consignados	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	19.108.114,14

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
CDI - BENCHMARK	**1,00**	**11,02**	**3,14**	**6,55**	**13,42**	**26,45**		
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,99	10,95	3,15	6,60	13,35	26,71	0,01	0,02
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,96	11,13	3,00	6,88	13,31	27,04	0,08	0,18
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,22	6,58	-0,48	2,11	6,96	17,25	0,87	1,83
GLOBAL BDRX - BENCHMARK	**-1,57**	**15,39**	**-1,87**	**6,65**	**18,36**	**-16,13**		
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40	14,42	-2,16	6,20	16,47	-17,58	7,82	16,48
IBOVESPA - BENCHMARK	**-2,94**	**3,11**	**-7,22**	**8,34**	**-2,49**	**9,32**		
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,85	27,41	-3,16	16,51	10,47	-13,23	8,85	18,63
BB INDEXADO IBOVESPA FIC AÇÕES	-3,02	2,14	-7,48	7,65	-3,48	6,68	7,26	15,29
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	-3,85	6,84	-5,78	8,33	-5,12	21,25	8,57	18,04
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,40	5,62	-6,79	5,34	-6,20	22,19	8,72	18,36
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,29	-8,29	-9,21	-1,31	-14,59	-4,03	6,54	13,78
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-7,30	-8,76	-16,03	-0,44	-22,96	-19,27	11,08	23,34
IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK	**-0,41**	**8,53**	**0,64**	**2,92**	**9,03**	**22,65**		
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29	8,48	0,84	3,19	9,04	22,01	1,24	2,60
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,33	8,23	0,62	3,00	8,84	22,05	1,32	2,78
IMA GERAL - BENCHMARK	**0,30**	**10,92**	**1,11**	**5,71**	**11,71**	**24,89**		
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,28	10,85	1,02	5,65	11,62	24,70	1,40	2,94
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
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,68	9,83	-2,09	3,68	8,73	20,76	3,00	6,31
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

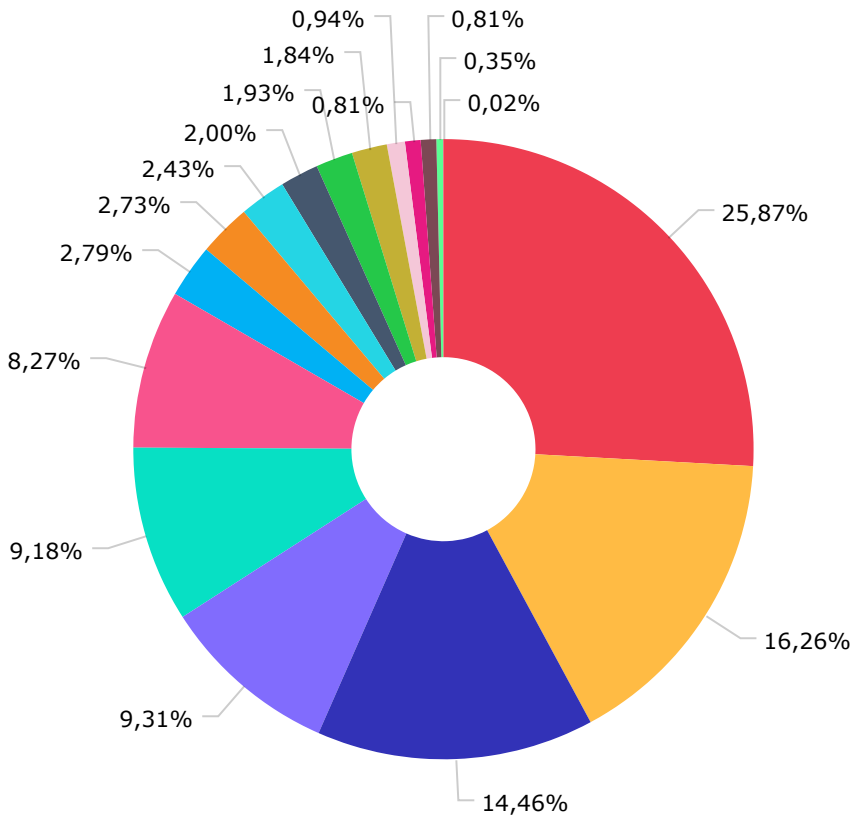
Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,71	9,92	-2,04	3,71	8,67	20,77	3,10	6,53
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
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	-0,33	8,33	0,35	2,95	8,94	22,26	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
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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,26	10,64	1,30	6,24	12,00	24,61	0,90	1,91
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,21	11,12	-0,14	5,42	9,56	22,83	2,29	4,81
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	-0,56	6,34	-0,80	4,10	5,98	18,69	2,35	4,95
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44		2,48				0,48	1,00
IRF-M - BENCHMARK	**0,37**	**12,04**	**1,31**	**6,68**	**12,95**	**26,45**		
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,93	10,95	3,01	6,48	13,27	26,21	0,12	0,24
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35	11,64	1,22	6,41	12,46	25,72	1,77	3,73
IRF-M 1 - BENCHMARK	**0,96**	**11,12**	**3,06**	**6,61**	**13,48**	**26,55**		
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94	10,95	2,99	6,48	13,26	26,00	0,12	0,25
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92	10,92	3,00	6,51	13,23	26,01	0,12	0,25
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92	10,82	2,97	6,45	13,13	25,83	0,12	0,25
IRF-M 1+ - BENCHMARK	**0,12**	**12,95**	**0,56**	**7,03**	**13,15**	**26,82**		
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09	12,66	0,46	6,89	12,72	25,93	2,54	5,35

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

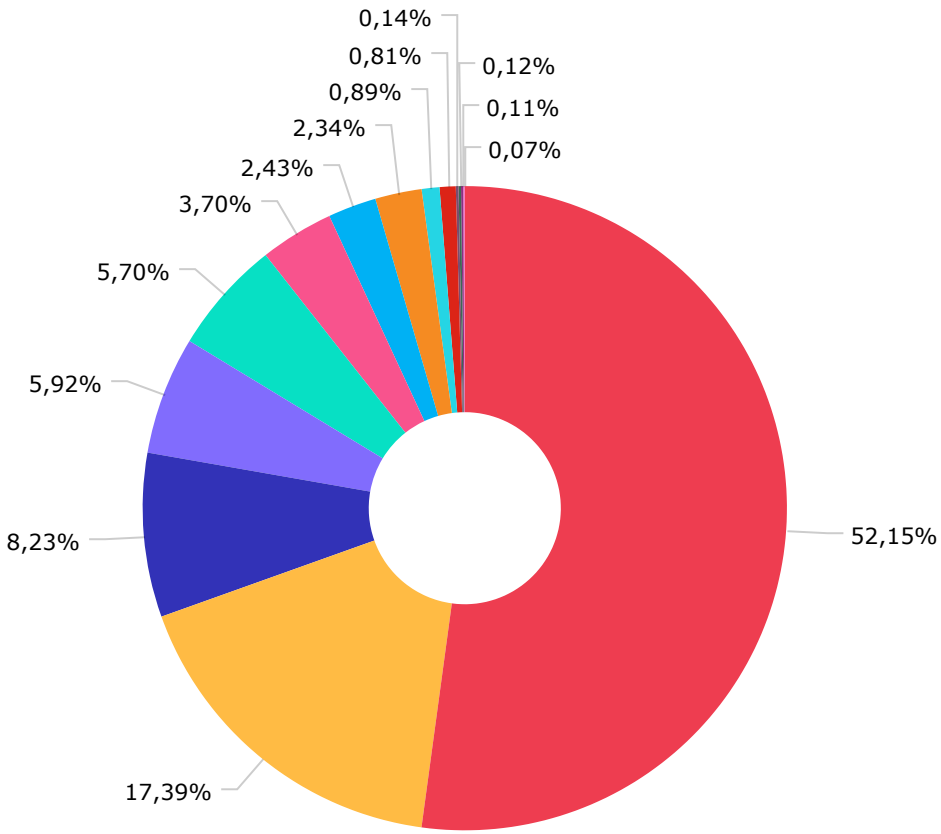
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
S&P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK	**-2,20**	**9,23**	**-8,61**	**0,58**	**8,31**	**-8,94**		
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-1,75	15,73	-7,00	4,28	16,83	7,03	7,19	15,14
SELIC - BENCHMARK	**1,00**	**11,02**	**3,14**	**6,55**	**13,42**	**26,45**		
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05	11,47	3,41	7,05	13,96	27,79	0,02	0,03
IPCA + 5,00% AO ANO - BENCHMARK	**0,65**	**8,03**	**1,97**	**3,50**	**10,06**	**23,04**		
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,44		-0,41				0,48	1,00
IPCA + 6,00% AO ANO - BENCHMARK	**0,73**	**8,88**	**2,21**	**3,99**	**11,11**	**25,39**		
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-0,31	8,89	0,69	3,48	9,55	23,60	1,62	3,41

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



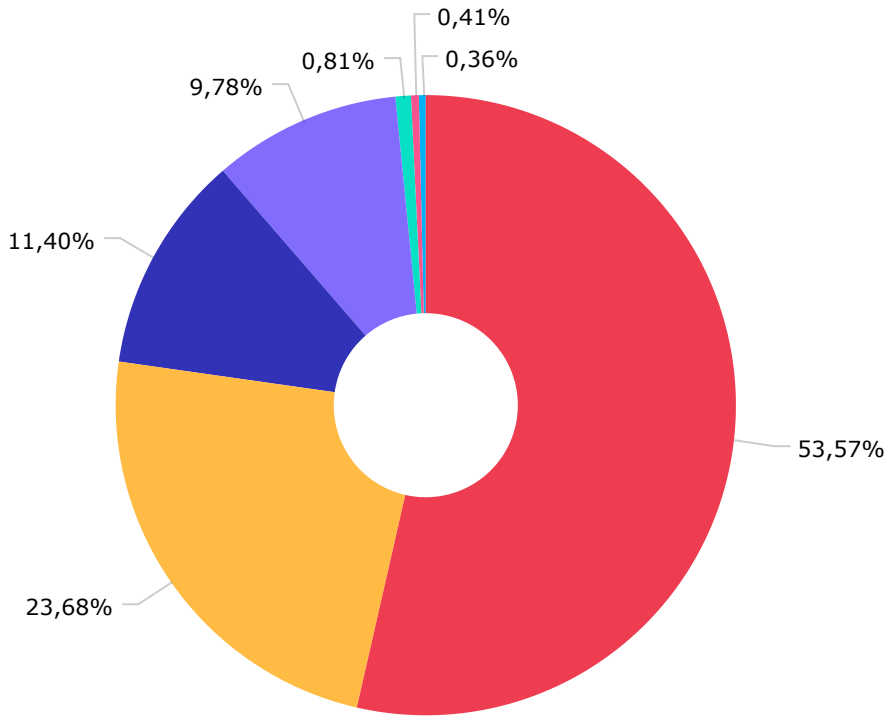
IRF-M 1	98.865.751,32
IMA-B 5	62.145.676,81
IPCA	55.268.788,94
CDI	35.575.016,90
IDKA IPCA 2 Anos	35.075.732,04
Selic	31.598.521,39
IPCA + 5,00% ao ano	10.664.632,51
Ibovespa	10.440.207,30
S&P 500 (Moeda Original)	9.276.642,39
Global BDRX	7.646.614,60
IPCA + 6,00% ao ano	7.380.313,60
IMA-B 5+	7.029.052,25
IMA-B	3.602.761,12
IMA Geral	3.113.060,71
Disponibilidades Financeiras	3.077.211,23
IRF-M	1.333.474,64
IRF-M 1+	68.824,95

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



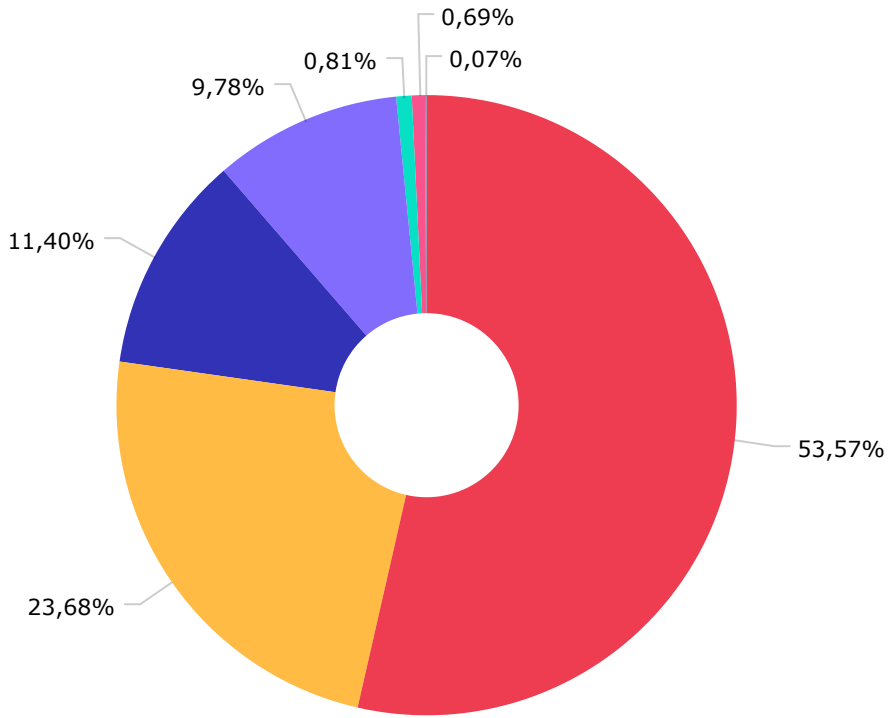
Renda Fixa Indexados	199.278.546,94
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento	66.459.267,39
Não classificado	31.443.693,05
Renda Fixa Duração Livre Soberano	22.628.778,51
Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre	21.792.189,92
Ações Livre	14.152.957,94
Multimercados Estratégia Específica	9.276.642,39
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento	8.929.943,45
Ações Setoriais	3.415.663,45
Disponibilidades Financeiras	3.077.211,23
Ações Indexados	518.200,51
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento	474.917,02
Multimercados Juros e Moedas	430.975,20
Multimercados Macro	283.295,70

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



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	204.720.616,20
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	90.497.228,07
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEME...	43.554.308,29
ITAU UNIBANCO S.A.	37.391.656,80
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.077.211,23
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA...	1.549.629,85
XP GESTAO DE RECURSOS LTDA	1.371.632,26

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	204.720.616,20
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	90.497.228,07
BANCO BRADESCO S.A.	43.554.308,29
ITAU UNIBANCO S.A.	37.391.656,80
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.077.211,23
INTRAG DTVM LTDA	2.637.966,41
BNY MELLON SERVIÇOES FINANCEIR...	283.295,70

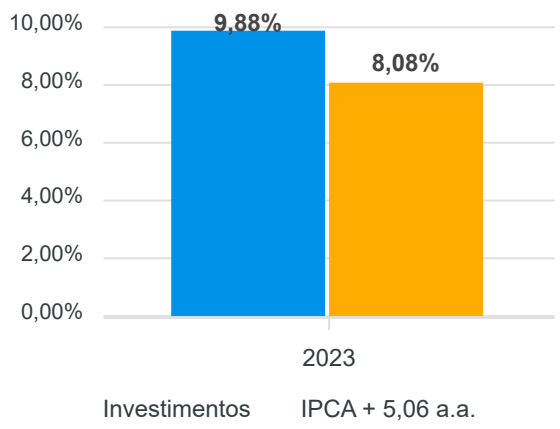
Mais Valia Consultoria Ltda EPP
Rua General Artigas 232 - Loja 301 - Leblon - Rio de Janeiro/RJ
CEP: 22441-140 - (21)99614-6774 / (21)99739-9777

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%
Setembro	372.863.918,79	3.380.727,22	1.175.488,42	376.087.003,68	1.017.846,09	32.463.741,63	0,27% ▲	9,71%	0,65%	7,38%	131,57%	0,97%
Outubro	376.087.003,68	8.618.203,57	6.214.323,22	379.085.071,47	594.187,44	33.057.929,07	0,16% ▲	9,88%	0,65%	8,08%	122,28%	1,30%

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%
3º Trim	7.804.346,08	2,14%	1,88%

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

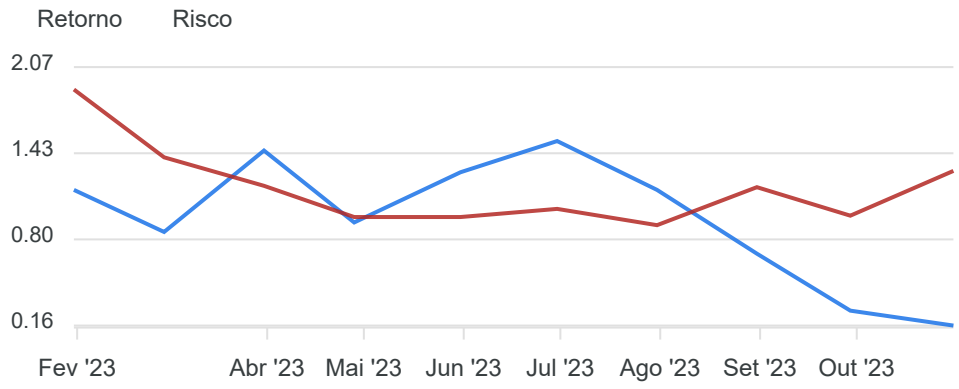
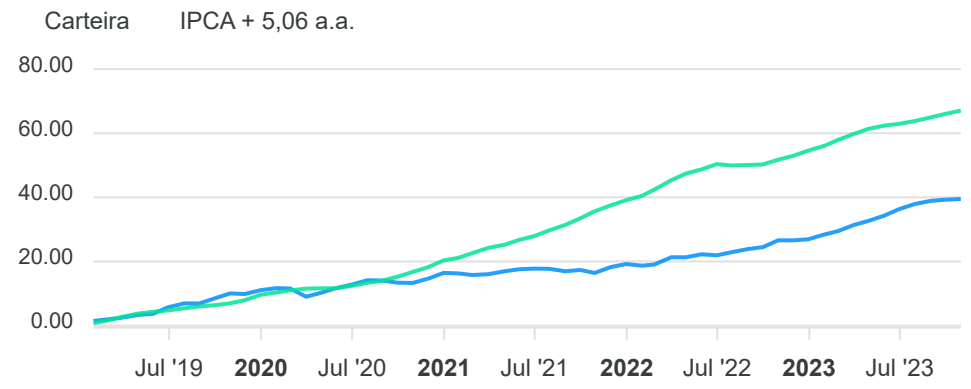
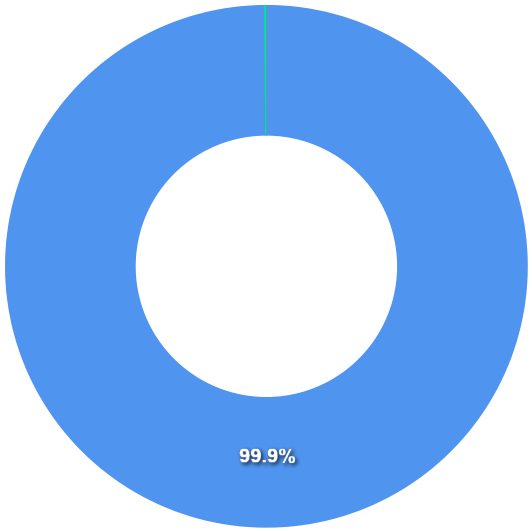


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 31/10/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	381.605.873,98	100,66
Até D+180	556.408,72	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	9.473.764,25	0,00	0,00	9.554.368,99	80.604,74	0,85% ▲	0,26%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.408.084,75	0,00	0,00	5.390.252,19	-17.832,56	-0,33% ▼	1,32%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	745.001,93	0,00	0,00	739.948,26	-5.053,67	-0,68% ▼	3,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.408.558,92	0,00	0,00	1.399.066,50	-9.492,42	-0,67% ▼	3,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.861.427,59	0,00	0,00	12.980.289,50	118.861,91	0,92% ▲	0,12%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	856.605,57	0,00	0,00	859.632,13	3.026,56	0,35% ▲	1,77%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	29.503.984,84	5.051.013,01	0,00	34.860.746,00	305.748,15	0,88% ▲	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.687.213,55	0,00	0,00	20.779.060,54	91.846,99	0,44% ▲	0,48%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.639.742,96	0,00	4.631.845,35	0,00	-7.897,61	-0,17% ▼	1,32%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	476.480,56	0,00	0,00	474.917,02	-1.563,54	-0,33% ▼	1,43%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.375.853,56	0,00	0,00	11.480.869,88	105.016,32	0,92% ▲	0,12%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	28.048.198,22	3.226.892,42	0,00	31.598.521,39	323.430,75	1,03% ▲	0,02%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.617.433,70	0,00	0,00	10.664.632,51	47.198,81	0,44% ▲	0,48%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.710.315,61	0,00	1.123.460,83	1.593.539,64	6.684,86	0,25% ▲	0,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.772.337,08	0,00	0,00	29.685.479,85	-86.857,23	-0,29% ▼	1,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	61.869.794,52	0,00	0,00	61.670.759,79	-199.034,73	-0,32% ▼	1,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.097.332,27	0,00	0,00	7.029.052,25	-68.280,02	-0,96% ▼	4,57%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	498.138,74	0,00	0,00	494.828,79	-3.309,95	-0,66% ▼	3,00%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.104.261,65	0,00	0,00	3.113.060,71	8.799,06	0,28% ▲	1,40%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.403.209,60	0,00	0,00	7.380.313,60	-22.896,00	-0,31% ▼	1,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	73.414.287,26	340.298,14	39.849,38	74.404.591,94	689.855,92	0,94% ▲	0,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	68.761,81	0,00	0,00	68.824,95	63,14	0,09% ▲	2,54%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	975.863,97	0,00	0,00	968.917,57	-6.946,40	-0,71% ▼	3,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	21.837.615,78	0,00	0,00	21.792.189,92	-45.425,86	-0,21% ▼	2,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	469.498,82	0,00	0,00	473.842,51	4.343,69	0,93% ▲	0,12%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1.558.369,64	0,00	0,00	1.549.629,85	-8.739,79	-0,56% ▼	2,35%

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
	346.882.137,15	8.618.203,57	5.795.155,56	351.007.336,28	1.302.151,12	0,37%	0,80%

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	534.348,52	0,00	0,00	518.200,51	-16.148,01	-3,02% ▼	7,26%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	222.499,31	0,00	221.104,53	0,00	-1.394,78	-0,63% ▼	7,59%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	202.613,60	0,00	198.063,13	0,00	-4.550,47	-2,25% ▼	8,24%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.755.615,48	0,00	0,00	3.594.612,65	-161.002,83	-4,29% ▼	6,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.966.947,27	0,00	0,00	1.823.394,13	-143.553,14	-7,30% ▼	11,08%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	578.714,28	0,00	0,00	556.408,72	-22.305,56	-3,85% ▼	8,57%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	556.384,27	0,00	0,00	531.927,84	-24.456,43	-4,40% ▼	8,72%
-	7.817.122,73	0,00	419.167,66	7.024.543,85	-373.411,22	-4,78%	8,10%

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	426.861,57	0,00	0,00	430.975,20	4.113,63	0,96% ▲	0,08%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	9.441.625,87	0,00	0,00	9.276.642,39	-164.983,48	-1,75% ▼	7,19%
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	283.922,42	0,00	0,00	283.295,70	-626,72	-0,22% ▼	0,87%
-	10.152.409,86	0,00	0,00	9.990.913,29	-161.496,57	-1,59%	6,70%

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

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno $	Retorno %	Risco - VaR
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.480.213,44	0,00	0,00	3.415.663,45	-64.549,99	-1,85% ▼	8,85%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.755.120,50	0,00	0,00	7.646.614,60	-108.505,90	-1,40% ▼	7,82%
	11.235.333,94	0,00	0,00	11.062.278,05	-173.055,89	-1,54%	2,73%

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

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 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.

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.

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

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

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