

Relatório de Investimento

Setembro - 2022



SECRETARIA DE ESTADO
DA ADMINISTRAÇÃO



SERGIPE
GOVERNO DO ESTADO

Governador do Estado de Sergipe
Belivaldo Chagas da Silva

Vice-Governadora
Eliane Aquino Custódio

Secretário de Estado da Administração
Manuel Dernival Santos Netos

Diretor Presidente
José Roberto de Lima Andrade

Diretor de Previdência
Gildo de Souza Xavier Filho

Diretor Administrativo e Financeiro
José Normando da Mota Guimarães Filho

1.0. Glossário

Benchmark: Indicador de retorno do fundo;

CDI (Certificado de Depósito Interbancário): Trata-se de uma taxa com lastro em operações realizadas entre instituições bancárias. Ou seja, são títulos que as instituições financeiras emitem, com o objetivo de transferir seus recursos para outra instituição. Esta emissão geralmente dura um curto período. O termo serve como referencial para o rendimento de quem atua com investimentos de Renda Fixa, como o CDB, LCI e LCA.

Finanprev: O Fundo Financeiro Previdenciário de Sergipe (Finanprev) funciona em um regime de financiamento de repartição simples, destinado àqueles que ingressaram no serviço público antes do ano de 2008. No Finanprev, as contribuições arrecadadas se destinam a atender apenas o pagamento dos benefícios atualmente concedidos: a contribuição do ativo é que paga o benefício do inativo. Ele existirá até a extinção dos segurados filiados a esse sistema de financiamento.

IMA-B: Índice formado por títulos públicos indexados à inflação medida pelo IPCA (Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo), que são as NTN-Bs (Notas do Tesouro Nacional – Série B ou Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais).

VaR: É um método de fácil compreensão e amplamente utilizado para a gestão, mensuração e controle dos diversos riscos de mercado. O VaR mensura, em condições normais de mercado e considerando um certo grau de confiança num horizonte de tempo, a perda esperada máxima de um título ou de uma carteira de títulos. VaR é uma medida que evidencia a exposição da carteira ao risco de mercado, resume a perda máxima esperada.

TPF: Títulos Públicos Federais.

2.0. Carteira de Investimentos (Setembro/2022)

2.1. Tabela 1 - FINANPREV - Demonstrativo da Carteira (Setembro/2022)

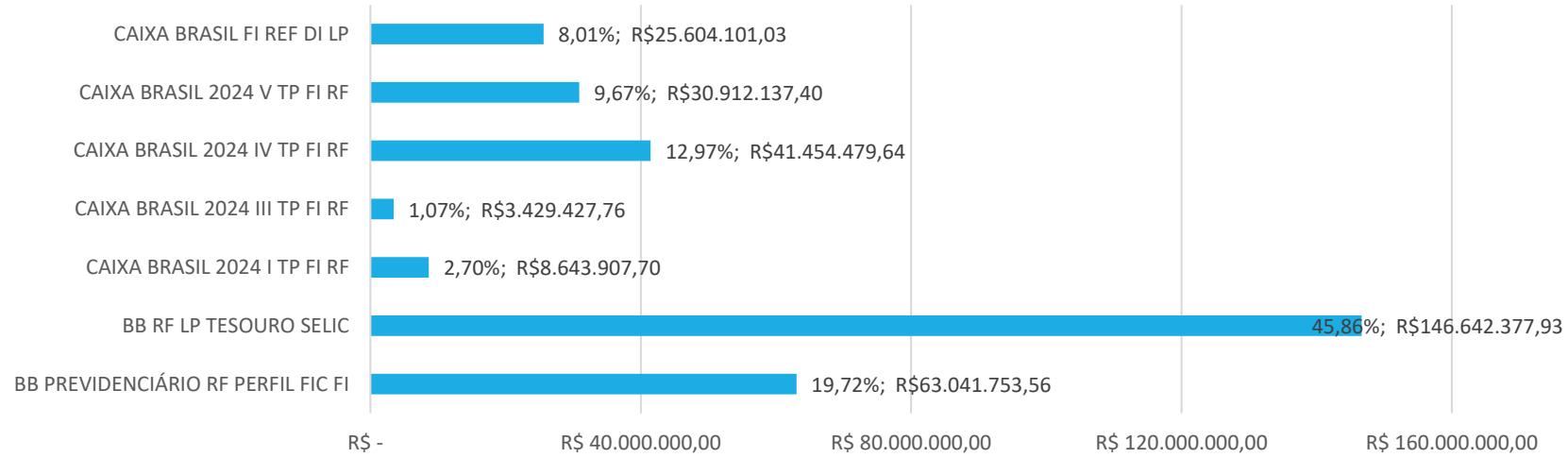
FUNDO	CNPJ	GESTOR	TIPO	BENCHMARK	% ALOCADO POR FUNDO	QTD. COTAS	VALOR DA COTA DO FUNDO (R\$)	RENTABILIDADE MENSAL	ALOCÇÃO (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	13.077.418/0001-49	BB DTVM S.A	RENDA FIXA	CDI	19,7%	23.512.298	2,681224653	1,09	R\$ 63.041.753,56
BB RF LP TESOURO SELIC	4.857.834/0001-79	BB DTVM S.A	RENDA FIXA	SELIC	45,9%	20.624.130	7,110233452	1,06	R\$ 146.642.377,93
CAIXA BRASIL FI REF DI LP	03.737.206/0001-97	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	RENDA FIXA	CDI	8,0%	5.876.921	4,35672	1,10	R\$ 25.604.101,03
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	18.598.288/0001-03	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	RENDA FIXA	IMA-B	2,7%	4.932.552	1,752421	0,48 (a)	R\$ 8.643.907,70
CAIXA BRASIL 2024 III TP FI RF	19.769.135/0001-44	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	RENDA FIXA	IMA-B	1,1%	1.973.084	1,73810499	0,48 (a)	R\$ 3.429.427,76
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	20.139.595/0001-78	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	RENDA FIXA	IMA-B	13,0%	26.184.279	1,583182	0,49 (a)	R\$ 41.454.479,64
CAIXA BRASIL 2024 V TP FI RF	19.768.682/0001-05	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	RENDA FIXA	IMA-B	9,7%	19.730.795	1,566695	0,48 (a)	R\$ 30.912.137,40
								TOTAL	R\$ 319.728.185,02

Nota (a): Rentabilidade dos fundos com marcação a mercado.

FONTE: ANBIMA / CVM / SISPREV.

2.2. Gráfico 1 - FINANPREV - Carteira de Investimentos

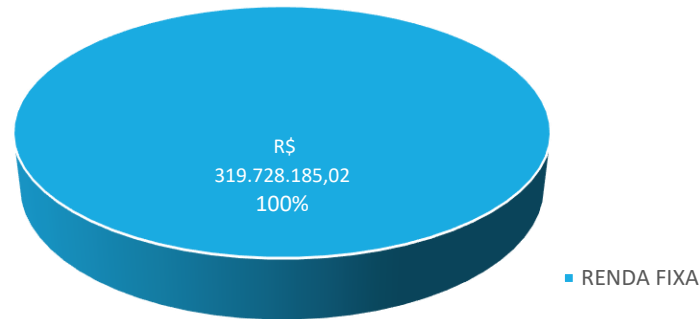
Composição da Carteira



FORNTE: SISPREV.

2.3. Gráfico 2 - FINANPREV - Composição da Carteira por Segmento

Composição da Carteira por Segmento



FORNTE: SISPREV.

3.0. Performance da Carteira (Setembro/2022)

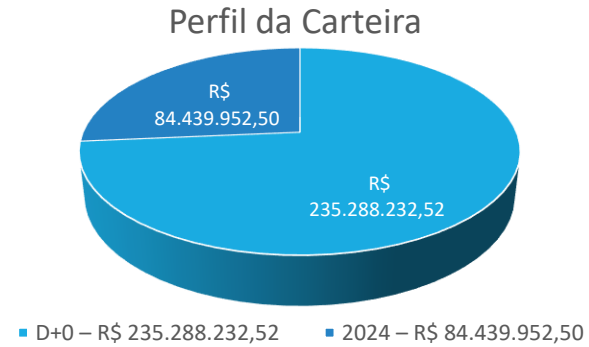
3.1 Tabela 2 - FINANPREV - Performance da Carteira (Setembro/2022)

FUNDO	PRAZO DE RESGATE	RISCO CLASSIFICADO PELO ADMINISTRADOR (1 A 5)	BENCHMARK	BENCHMARK	RENTABILIDADE DO FUNDO	VAR 95 % (a)
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	SEM CARÊNCIA	2	CDI	1,07%	1,09%	0,0000%
BB RF LP TESOIRO SELIC	SEM CARÊNCIA	2	SELIC	1,07%	1,07%	0,0000%
CAIXA BRASIL FI REF DI LP	SEM CARÊNCIA	1	CDI	1,07%	1,11%	0,0391%
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	16/08/2024	3	IMA-B	1,48%	0,48%	1,8298%
CAIXA BRASIL 2024 III TP FI RF	16/08/2024	3	IMA-B	1,48%	0,48%	1,8290%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	16/08/2024	3	IMA-B	1,48%	0,49%	1,8299%
CAIXA BRASIL 2024 V TP FI RF	16/08/2024	3	IMA-B	1,48%	0,48%	1,8294%

FONTE: BB/CAIXA/CVM/SISPREV.

4.0. Horizonte da Carteira (Setembro/2022)

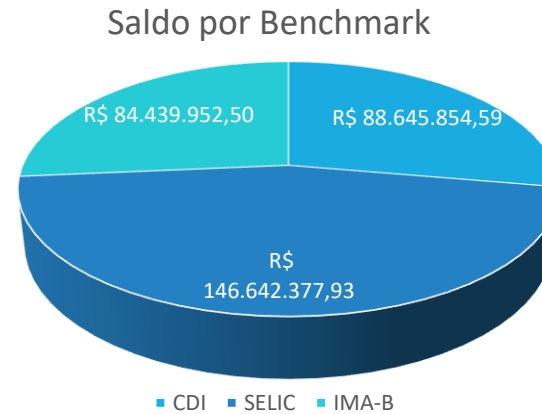
4.1. Gráfico 3 - FINANPREV - Perfil da Carteira



FONTE: GEAINV.

5.0. Benchmark da Carteira (Setembro/2022)

5.3. Gráfico 4 - FINANPREV - Saldo Por Benchmark



FONTE: GEAINV.

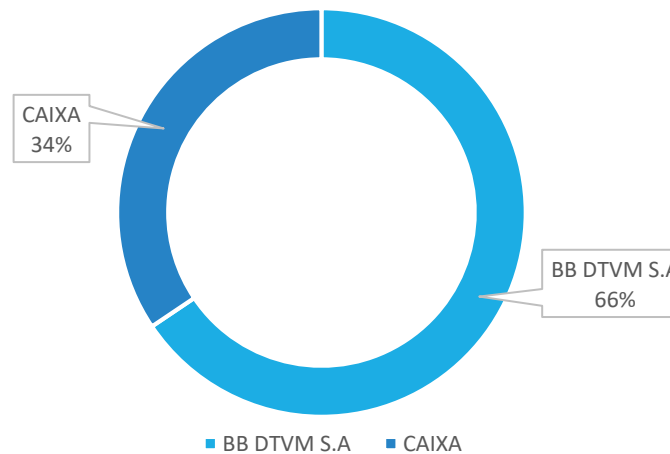
6.0. Ranking do Administrador e Gestor (Setembro/2022)

6.1.Tabela 3 - FINANPREV - Ranking do Administrador e Gestor dos fundos aplicados.

ADMINISTRADORES	RANKING DO ADMINISTRADOR PL POR CLASSE	GESTOR	RANKING DO GESTOR PL POR CLASSE	% CARTEIRA	VALOR
BB DTVM S.A	1	BB DTVM S.A	1	66%	R\$ 209.684.131,49
CAIXA	3	CAIXA ASSET	4	34%	R\$ 110.044.053,53
Nota (a): Ranking referente ao mês de junho.				TOTAL	100% R\$ 319.728.185,02

FONTE: CVM / SISPREV.

6.5 Gráfico 5- FINANPREV - Saldo Por Benchmark



FONTE: SISPREV.

7.0. Enquadramentos da Carteira (Setembro/2022)

7.1 Tabela 4 - FINANPREV - Enquadramentos

SEGMENTO / FUNDO DE INVESTIMENTO	ENQUADRAMENTO NA RESOLUÇÃO Nº 4.963/2021	VALOR APLICADO (R\$)	DISTRIBUIÇÃO POR FI (%)
BB RF LP TESOIRO SELIC	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 146.642.377,93	45,86%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	ARTIGO 7, INCISO III 'A'	R\$ 63.041.753,56	19,72%
CAIXA BRASIL FI REF DI LP	ARTIGO 7, INCISO III 'A'	R\$ 25.604.101,03	8,01%
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 8.643.907,70	2,70%
CAIXA BRASIL 2024 III TP FI RF	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 3.429.427,76	1,07%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 41.454.479,64	12,97%
CAIXA BRASIL 2024 V TP FI RF	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 30.912.137,40	9,67%
	TOTAL	R\$ 319.728.185,02	100,0%

FONTE: GEAINV.

8.0. Política Anual de Investimento (P.A.I) - (Setembro/2022)

8.1 Tabela 5 - FINANPREV - Política Anual de Investimento

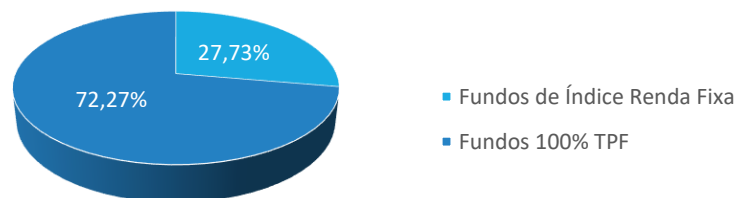
TIPO	SEGMENTO	RESOLUÇÃO	P.A.I	ALOCAÇÃO
Fundos de Índice Renda Fixa	RENDA FIXA	60%	60%	27,73%
Fundos 100% TPF	RENDA FIXA	100%	100%	72,27%

Nota: TPF (Títulos Públicos Federais)

FONTA: SISPREV.

8.2. Gráfico 6 - FINANPREV - Política Anual de Investimento

Política Anual de Investimento - P.A.I - 2022



FONTA: SISPREV.

9.0. Composição da Carteria por Instituição (Setembro/2022)

9.1. Tabela 6 - FINANPREV - Composição da Carteria por Instituidor

INSTITUIÇÃO	TOTAL APLICADO	%
Banco do Brasil S.A.	R\$ 209.684.131,49	65,58%
Caixa Econômica Federal	R\$ 110.044.053,53	34,42%

FONTA: SISPREV.

10.0. Evolução do Patrimônio

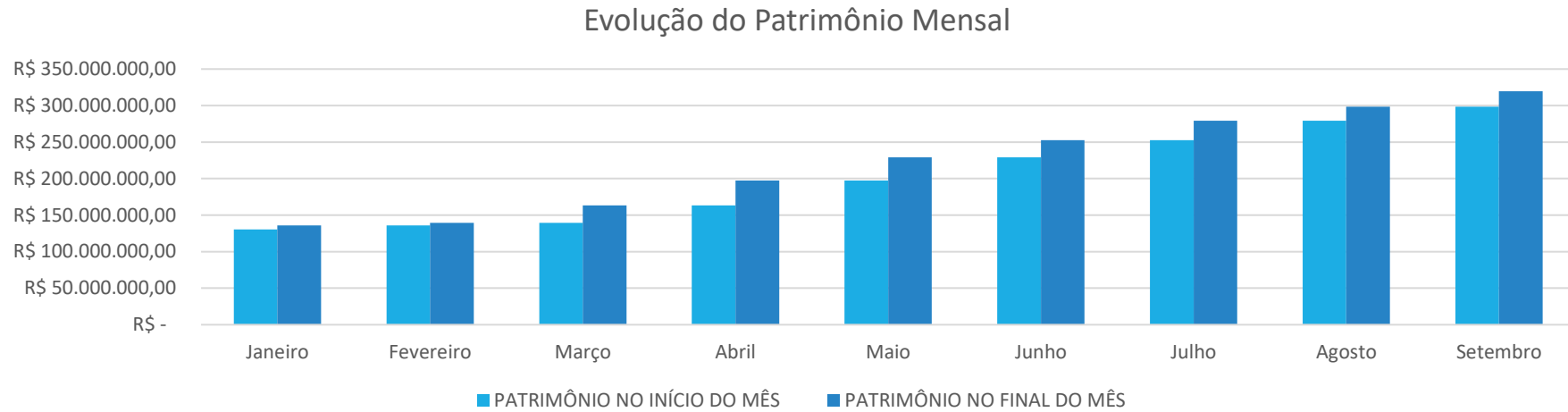
10.1. Tabela 7 - FINANPREV - Evolução do Patrimônio

MÊS	PATRIMÔNIO INICIAL	APLICAÇÕES	RESGATES	AMORTIZAÇÃO (a)	RENTABILIDADE CARTEIRA	PATRIMÔNIO FINAL
Janeiro	R\$ 130.519.125,07	R\$ 120.204.313,12	R\$ 115.050.000,00	R\$ -	R\$ 428.500,12	R\$ 136.101.938,31
Fevereiro	R\$ 136.101.938,31	R\$ 7.300.291,10	R\$ 3.200.000,00	-R\$ 2.217.553,74	R\$ 1.329.294,04	R\$ 139.313.969,71
Março	R\$ 139.313.969,71	R\$ 33.400.000,00	R\$ 12.200.000,00	R\$ -	R\$ 2.780.276,22	R\$ 163.294.245,93
Abril	R\$ 163.294.245,93	R\$ 46.836.939,88	R\$ 14.300.000,00	R\$ -	R\$ 1.715.403,36	R\$ 197.546.589,17
Maiο	R\$ 197.546.589,17	R\$ 209.913.711,67	R\$ 180.400.668,87	R\$ -	R\$ 2.061.318,95	R\$ 229.120.950,92
Junho	R\$ 229.120.950,92	R\$ 157.660.494,12	R\$ 135.721.588,64	R\$ -	R\$ 1.675.235,06	R\$ 252.735.091,46
Julho	R\$ 252.735.091,46	R\$ 275.878.177,61	R\$ 249.930.757,28	R\$ -	R\$ 566.518,16	R\$ 279.249.029,95
Agosto	R\$ 279.249.029,95	R\$ 58.608.209,50	R\$ 38.950.000,00	-R\$ 2.524.817,54	R\$ 2.107.134,59	R\$ 298.489.556,50
Setembro	R\$ 298.489.556,50	R\$ 61.750.000,00	R\$ 43.200.000,00	R\$ -	R\$ 2.688.628,52	R\$ 319.728.185,02
	Total	R\$ 971.552.137,00	R\$ 792.953.014,79	-R\$ 4.742.371,28	R\$ 20.094.680,30 (b)	

Nota (a): Pagamento de cupom semestral. Nota (b): Rentabilidade da Carteira + Os Cupons Semestrais.

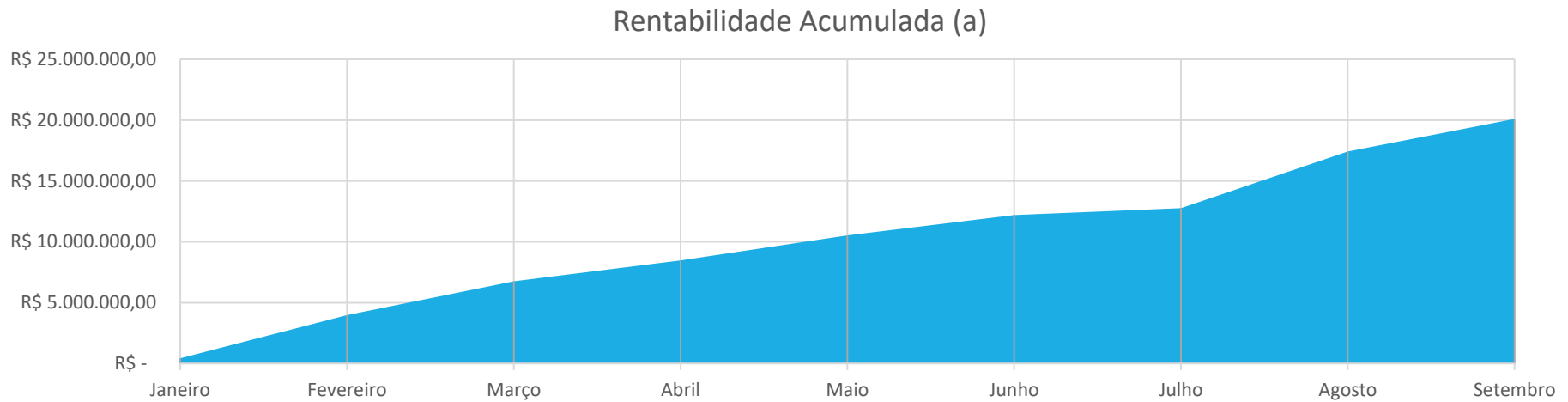
FONTE: SISPREV.

10.2.Gráfico 7 - FINANPREV - Evolução do Patrimônio



FORNTE: SISPREV.

10.3.Gráfico 8 - FINANPREV - Rentabilidade Acumulada (R\$)



Nota (a): Rentabilidade da Carteira + Os Cupons Semestrais.

FORNTE: SISPREV.

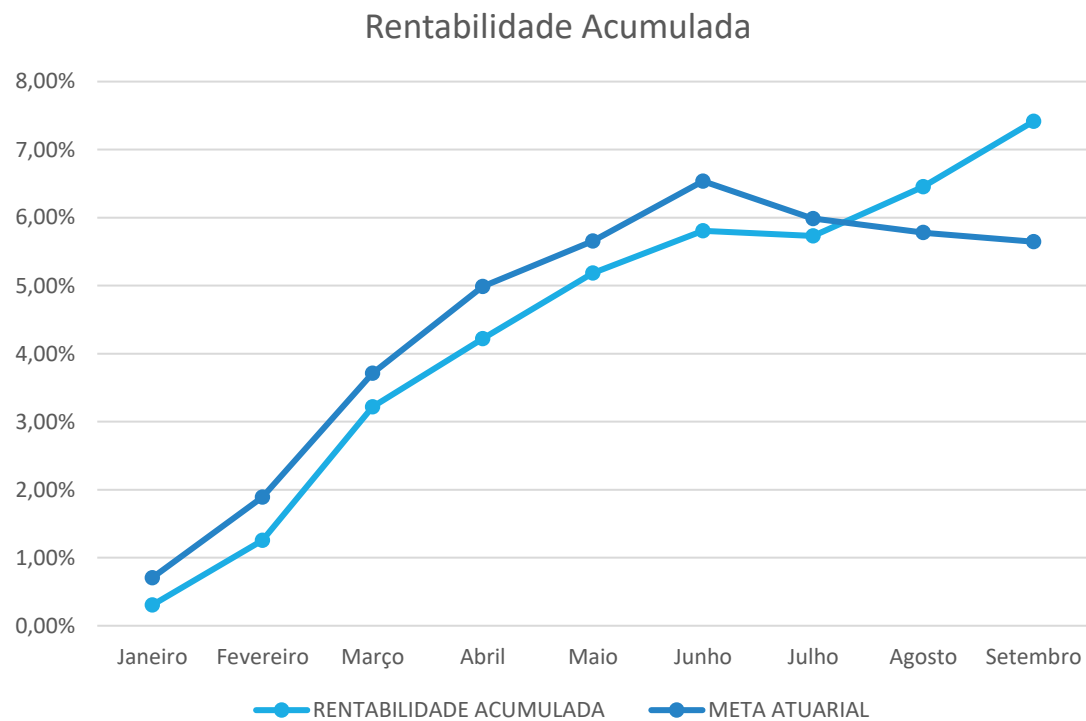
11.0. Rentabilidade da Carteira

11.1. Tabela 8 - FINANPREV - Rentabilidade Acumulada

MÊS	% RENTABILIDADE DA CARTEIRA	RENTABILIDADE ACUMULADA	META ATUARIAL
Janeiro	0,30%	0,30%	0,71%
Fevereiro	0,95%	1,26%	1,89%
Março	1,94%	3,22%	3,71%
Abril	1,01%	4,22%	4,99%
Maiο	0,99%	5,19%	5,65%
Junho	0,72%	5,81%	6,54%
Julho	0,22%	5,73%	5,99%
Agosto	0,76%	6,45%	5,78%
Setembro	0,91%	7,41%	5,65%

FONTE: SISPREV.

11.2. Gráfico 9 - FINANPREV - Rentabilidade Acumulada



FONTE: SISPREV.



SECRETARIA DE ESTADO DA ADMINISTRAÇÃO

CERTIDÃO DE DELIBERAÇÕES DO CEPS

Eu, Marcelo Passos Silva, Secretário do Conselho Estadual da Previdência, certifico para devidos fins e a quem possa interessa que na última Reunião Ordinária (193ª) do Conselho Estadual da Previdência, realizada em 26 de janeiro de 2023, foram deliberados e aprovados por unanimidade os Balancetes Novembro/2022 e Dezembro/22 do FINAPREV; os Relatórios de investimentos de Agosto/2022 a Dezembro/2022, e anual do FINANPREV, bem como foram apresentados os Relatórios de Governança 3º e 4º trimestre do SERGIPEPREVIDÊNCIA. O referido é verdade e dou fé.

Aracaju/SE, 02 de fevereiro de 2023.

MARCELO PASSOS SILVA
Secretário(a) do CEPS