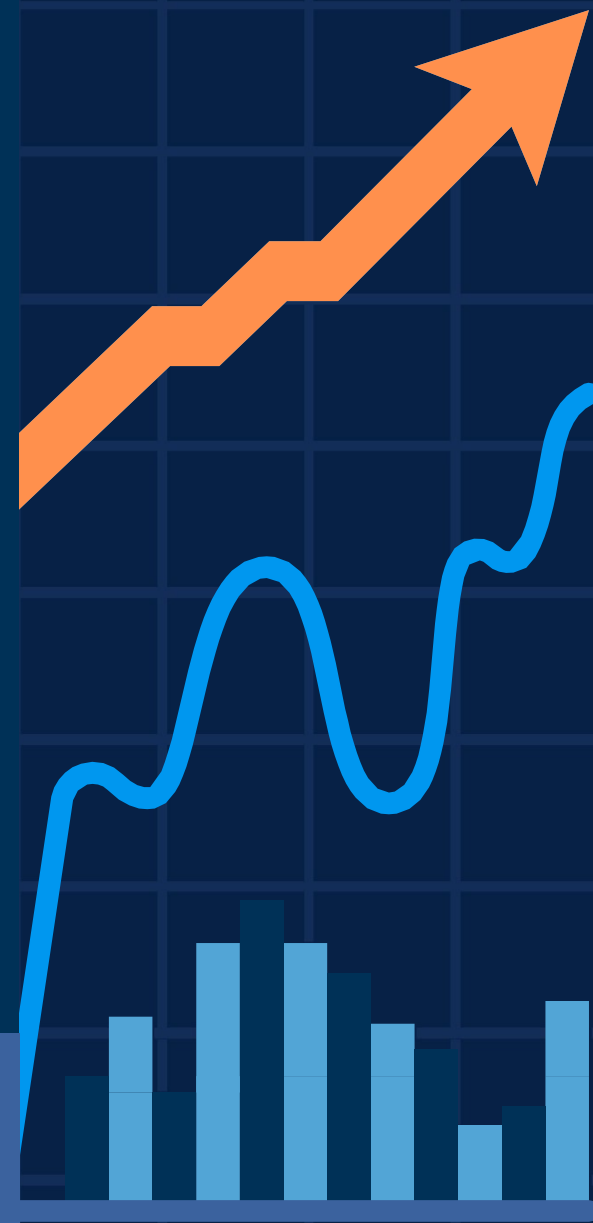


Relatório de Investimento

MAIO / 2023



SECRETARIA DE ESTADO
DA ADMINISTRAÇÃO



SERGIPE
GOVERNO DO ESTADO

Governador do Estado de Sergipe
Fábio Cruz Mitidieri

Vice-Governador
José Macedo Sobral

Secretária de Estado da Administração
Lucivanda Nunes Rodrigues

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 (Maio/2023)

2.1. Tabela 1 - FINANPREV - Demonstrativo da Carteira (Maio/2023)

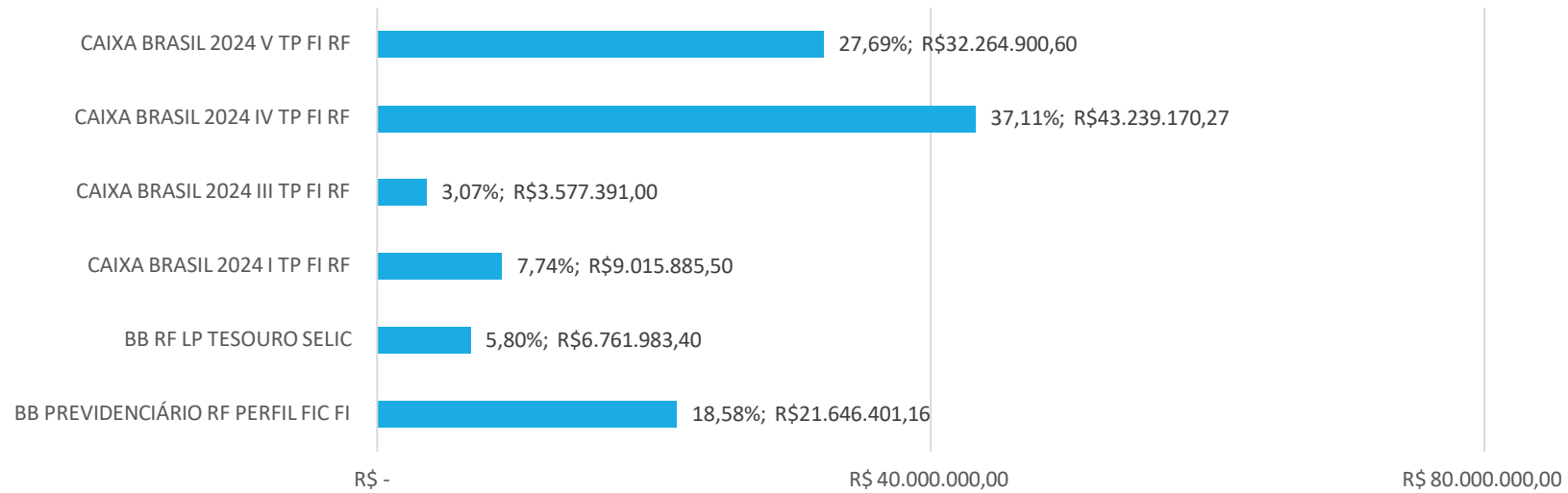
FUNDO	CNPJ	GESTOR	TIPO	BENCHMARK	% ALOCADO POR FUNDO	QTD. COTAS	VALOR DA COTA DO FUNDO (R\$)	RENTABILIDADE MENSAL	ALOCAÇÃO (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	13.077.418/0001-49	BB DTVM S.A	RENTA FIXA	CDI	18,58%	7.582.875	2,854642977	1,15	R\$ 21.646.401,16
BB RF LP TESOUREO SELIC	4.857.834/0001-79	BB DTVM S.A	RENTA FIXA	SELIC	5,80%	893.737	7,565968582	1,11	R\$ 6.761.983,40
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	18.598.288/0001-03	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	RENTA FIXA	IMA-B	7,74%	5.000.000	1,803177	-0,01 (a)	R\$ 9.015.885,50
CAIXA BRASIL 2024 III TP FI RF	19.769.135/0001-44	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	RENTA FIXA	IMA-B	3,07%	2.000.000	1,7886955	-0,01 (a)	R\$ 3.577.391,00
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	20.139.595/0001-78	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	RENTA FIXA	IMA-B	37,11%	26.543.317	1,629004	-0,01 (a)	R\$ 43.239.170,27
CAIXA BRASIL 2024 V TP FI RF	19.768.682/0001-05	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	RENTA FIXA	IMA-B	27,69%	20.000.000	1,613245	-0,01 (a)	R\$ 32.264.900,60
								TOTAL	R\$ 116.505.731,93

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

FONTE: ANBIMA / CVM / SISPREV.

2.2. Gráfico 1 - FINANPREV - Carteira de Investimentos

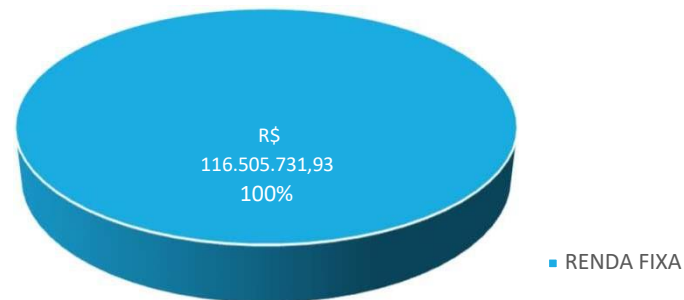
Composição da Carteira



FONTE: SISPREV.

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

Composição da Carteira por Segmento



FONTE: SISPREV.

3.0. Performance da Carteira (Maio/2023)

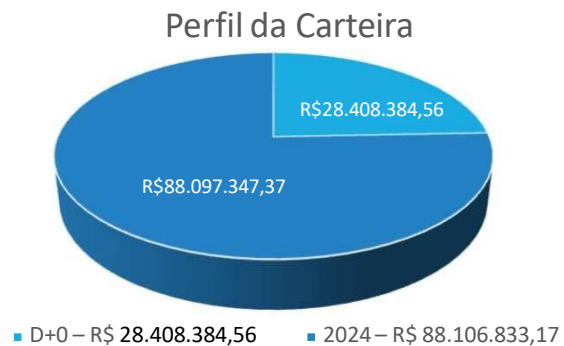
3.1 Tabela 2 - FINANPREV - Performance da Carteira (Maio/2023)

FUNDO	PRAZO DE RESGATE	RISCO CLASSIFICADO PELO ADMINISTRADOR (1 A 5)	BENCHMARK	BENCHMARK	RENTABILIDADE DO FUNDO	VAR 95 %
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	SEM CARÊNCIA	2	CDI	1,17%	1,15%	0,0000%
BB RF LP TESOIRO SELIC	SEM CARÊNCIA	2	SELIC	1,17%	1,11%	0,0000%
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	16/08/2024	3	IMA-B	2,66%	-0,01%	1,8298%
CAIXA BRASIL 2024 III TP FI RF	16/08/2024	3	IMA-B	2,66%	-0,01%	1,8290%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	16/08/2024	3	IMA-B	2,66%	-0,01%	1,8299%
CAIXA BRASIL 2024 V TP FI RF	16/08/2024	3	IMA-B	2,66%	-0,01%	1,8294%

FONTE: BB/CAIXA/CVM/SISPREV.

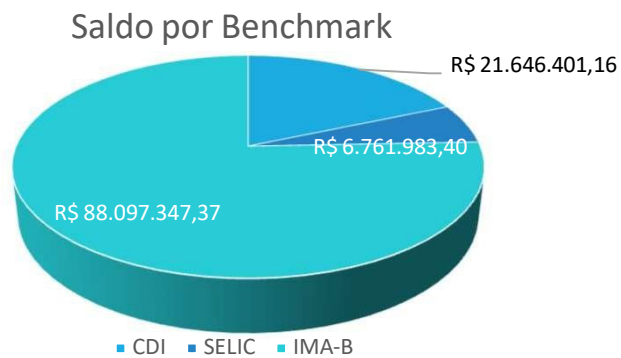
1.0. Horizonte da Carteira (Maio/2023)

2. Gráfico 3 - FINANPREV - Perfil da Carteira



FONTE: GEAINV.

5.0. Benchmark da Carteira (Maio/2023)



FONTE: GEAINV.

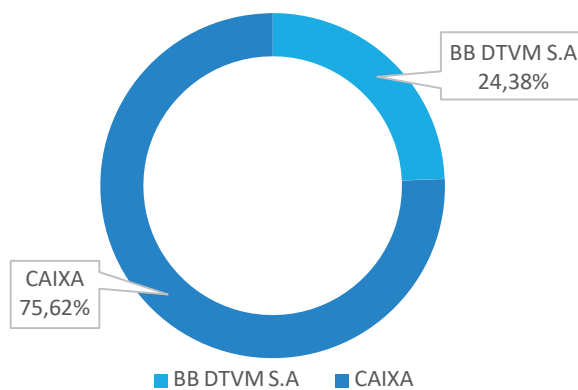
1.0. Ranking do Administrador e Gestor (Maio/2023)

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

ADMINISTRADORES	RANKING DO ADMINISTRADOR PL POR CLASSE (a)	GESTOR	RANKING DO GESTOR PL POR CLASSE (a)	% CARTEIRA	VALOR
BB DTVM S.A	1	BB DTVM S.A	1	24,38%	R\$ 28.408.384,56
CAIXA	3	CAIXA ASSET	4	75,62%	R\$ 88.097.347,37
Nota (a): Ranking referente ao mês de Fevereiro de 2023.			TOTAL	100%	R\$ 116.505.731,93

FONTE: CVM / SISPREV.

6.5 Gráfico 5- FINANPREV - Saldo Por Benchmark



FONTE: SISPREV.

7.0. Enquadramentos da Carteira (Maio/2023)

7.1 Tabela 4 - FINANPREV - Enquadramentos (Março/2023)

SEGMENTO / FUNDO DE INVESTIMENTO	ENQUADRAMENTO NA RESOLUÇÃO Nº 4.963/2021	VALOR APLICADO (R\$)	DISTRIBUIÇÃO POR FI (%)
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	ARTIGO 7, INCISO III 'A'	R\$ 21.646.401,16	18,58%
BB RF LP TESOIRO SELIC	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 6.761.983,40	5,80%
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 9.015.885,50	7,74%
CAIXA BRASIL 2024 III TP FI RF	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 3.577.391,00	3,07%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 43.239.170,27	37,11%
CAIXA BRASIL 2024 V TP FI RF	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 32.264.900,60	27,69%
	TOTAL	R\$ 116.505.731,93	100,0%

FONTE: GEAINV.

8.0. Política Anual de Investimento (P.A.I)

8.1 Tabela 5 - FINANPREV - Política Anual de Investimento (Maio/2023)

TIPO	SEGMENTO	RESOLUÇÃO	P.A.I	ALOCAÇÃO
Fundos de Índice Renda Fixa	RENDA FIXA	60%	60%	18,58%
Fundos 100% TPF	RENDA FIXA	100%	100%	81,13%

Nota: TPF (Títulos Públicos Federais)

FONTE: SISPREV.

8.2. Gráfico 6 - FINANPREV - Política Anual de Investimento
Política Anual de Investimento - P.A.I - 2022



FONTE: SISPREV.

9.0. Composição da Carteria por Instituição (Maio/2023)

9.1. Tabela 6 - FINANPREV - Composição da Carteira por Instituidor (Maio/2023)

INSTITUIÇÃO	TOTAL APLICADO	%
Banco do Brasil S.A.	R\$ 28.408.384,56	24,38%
Caixa Econômica Federal	R\$ 88.097.347,37	75,62%
Total	R\$ 116.505.731,93	100%

FONTE: SISPREV.

10.0. Evolução do Patrimônio

10.1.Tabela 7 - FINANPREV - Evolução do Patrimônio

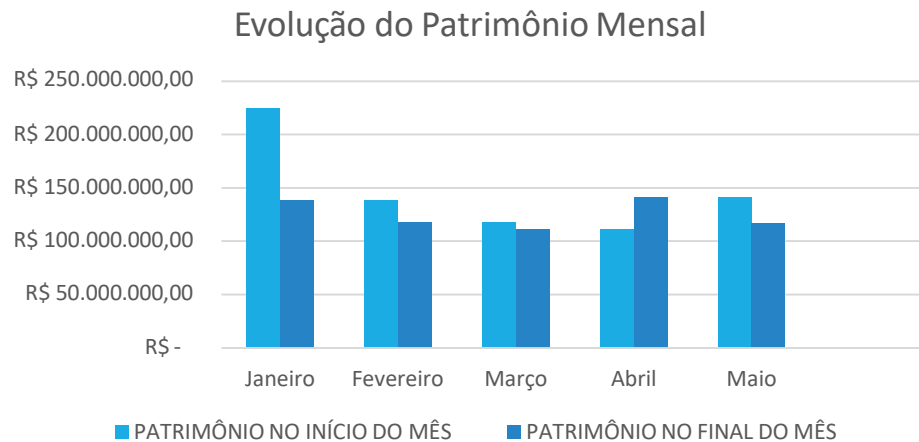
MÊS	PATRIMÔNIO INICIAL	APLICAÇÕES	RESGATES	AMORTIZAÇÃO (a)	RENTABILIDADE CARTEIRA	PATRIMÔNIO FINAL
Janeiro (c)	R\$ 224.438.145,79	R\$ 26.151.086,96	R\$ 114.911.364,32	R\$ -	R\$ 2.621.812,92	R\$ 138.299.681,35
Fevereiro	R\$ 138.299.681,35	R\$ 41.704.070,21	R\$ 61.853.097,80	-R\$ 2.543.268,58	R\$ 1.706.146,00	R\$ 117.313.531,18
Março	R\$ 117.313.531,18	R\$ 42.600.000,00	R\$ 51.000.000,00	R\$ -	R\$ 1.661.591,04	R\$ 110.575.122,22
Abril	R\$ 110.575.122,22	R\$ 60.278.175,60	R\$ 31.128.000,00	R\$ -	R\$ 863.165,39	R\$ 140.588.463,21
Maio	R\$ 140.588.463,21	R\$ 34.600.000,00	R\$ 59.400.877,61	R\$ -	R\$ 718.146,33	R\$ 116.505.731,93
Junho						
Julho						
Agosto						
Setembro						
Outubro						
Novembro						
Dezembro						
Total		R\$ 205.333.332,77	R\$ 318.293.339,73	-R\$ 2.543.268,58	R\$ 8.532.818,54 (b)	FONTE: SISPREV.

Nota (a): Pagamento de cupom semestral.

Nota (b): Rentabilidade da Carteira + Os Cupons Semestrais

Nota (c): Resgate de aplicação para pagamento de despesas previdenciárias.

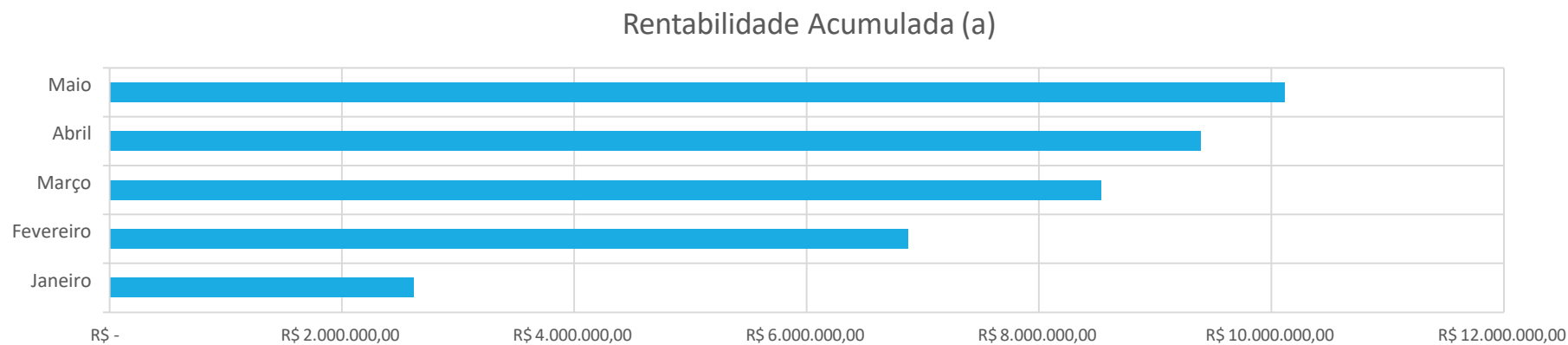
10.2.Gráfico 7 - FINANPREV - Evolução do Patrimônio



Nota(a) : Resgate de aplicação para pagamento de despesas previdenciárias.

FONTE: SISPREV.

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



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

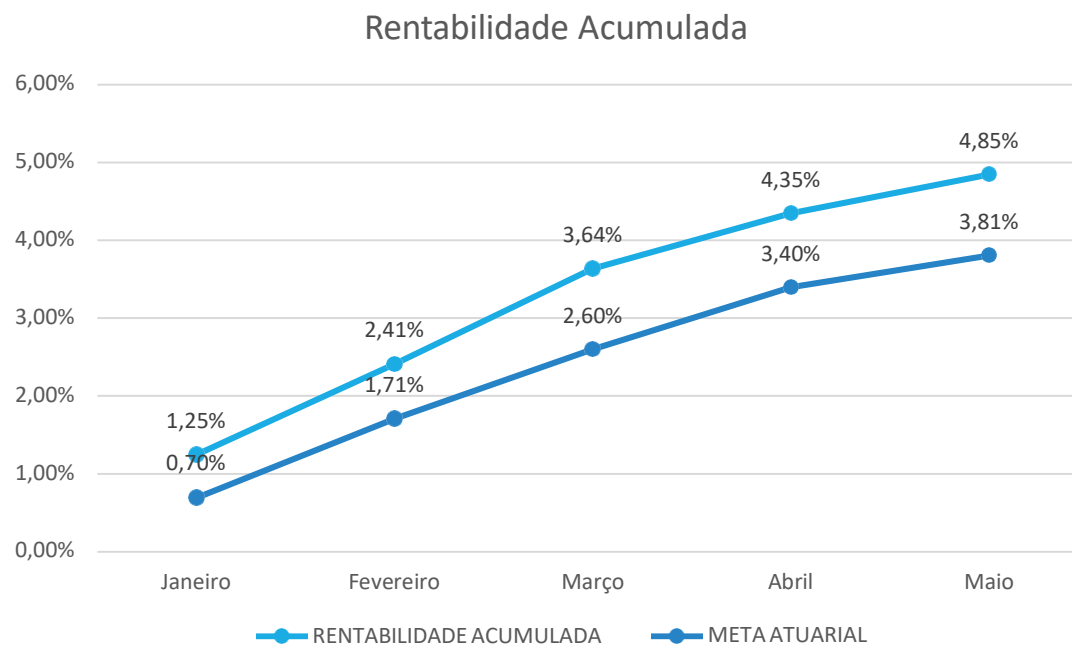
FONTE: SISPREV.

11.0. Rentabilidade da Carteira

8.1. Tabela 8 - FINANPREV - Rentabilidade Acumulada

MÊS	% RENTABILIDADE DA CARTEIRA	RENTABILIDADE ACUMULADA	META ATUARIAL
Janeiro	1,25%	1,25%	0,70%
Fevereiro	1,17%	2,41%	1,71%
Março	1,22%	3,64%	2,60%
Abril	0,63%	4,35%	3,40%
Maio	0,48%	4,85%	3,81%
Junho			
Julho			
Agosto			
Setembro			
Outubro			
Novembro			
Dezembro			

8.2. Gráfico 9 - FINANPREV - Rentabilidade Acumulada



FONTE: SISPREV.

FONTE: SISPREV.