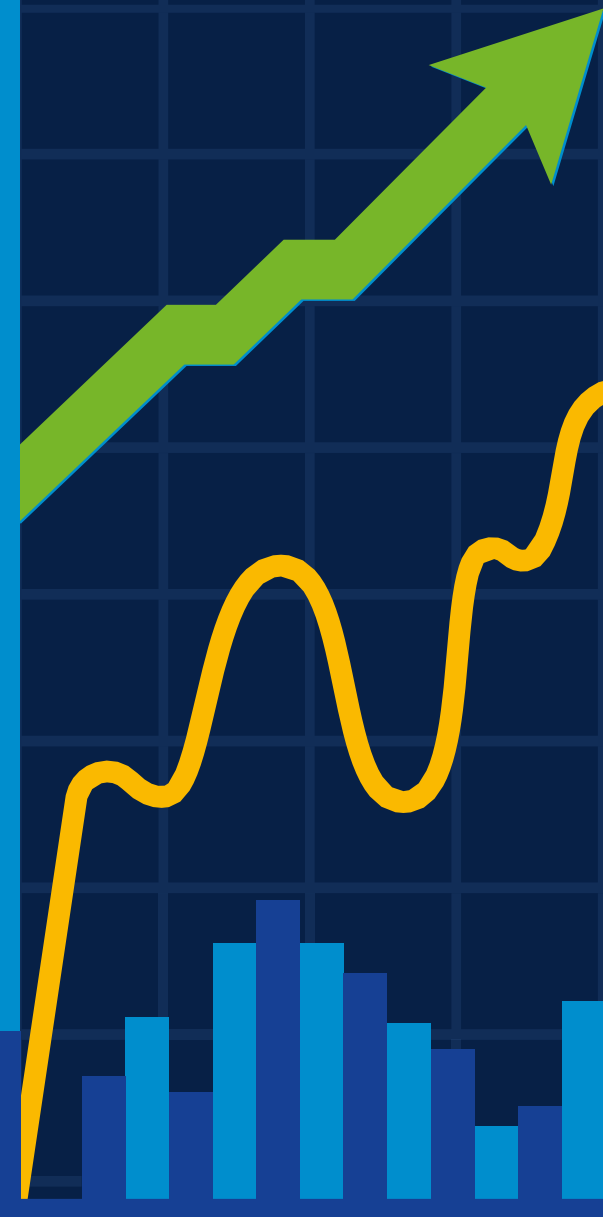


Relatório de Investimento

SETEMBRO / 2023



SECRETARIA DE ESTADO
DA ADMINISTRAÇÃO



SERGIPE
GOVERNO DO ESTADO

Governador do Estado de Sergipe
Fábio 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 dos servidores ativos, aposentados e pensionistas se destinam apenas ao pagamento dos benefícios de aposentadoria e pensões. 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 (21 dias úteis), 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/2023)

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

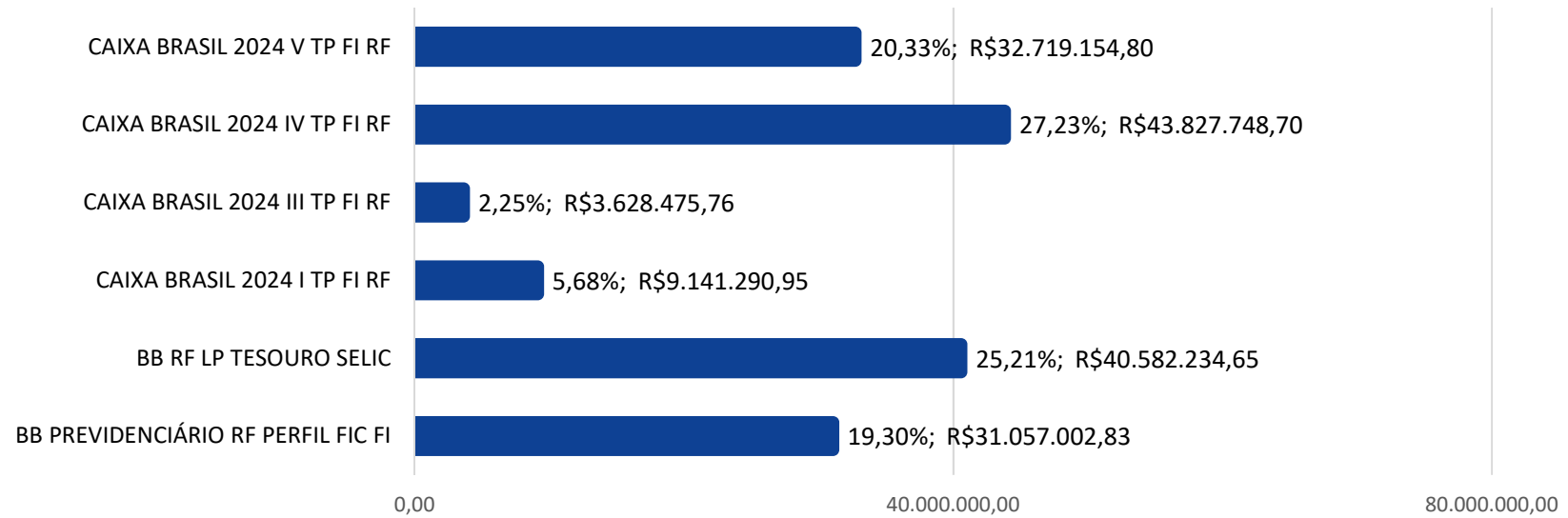
FUNDO	CNPJ	GESTOR	TIPO	BENCHMARK	% ALOCADO POR FUNDO	QTD. COTAS	VALOR DA COTA DO FUNDO (R\$)	RENTABILIDADE MENSAL	ALOCÇÃO (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	13.077.418/0001-49	BB DTVM S.A	RENDA FIXA	CDI	19,30%	10.425.812	2,978856849	0,96	R\$ 31.057.002,83
BB RF LP TESOIRO SELIC	4.857.834/0001-79	BB DTVM S.A	RENDA FIXA	SELIC	25,21%	5.145.045	7,88763473	0,95	R\$ 40.582.234,65
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	18.598.288/0001-03	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	RENDA FIXA	IMA-B	5,68%	5.054.858	1,808417	1,1 (a)	R\$ 9.141.290,95
CAIXA BRASIL 2024 III TP FI RF	19.769.135/0001-44	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	RENDA FIXA	IMA-B	2,25%	2.000.000	1,81423788	1,1 (a)	R\$ 3.628.475,76
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	20.139.595/0001-78	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	RENDA FIXA	IMA-B	27,23%	26.543.305	1,65117901	1,1 (a)	R\$ 43.827.748,70
CAIXA BRASIL 2024 V TP FI RF	19.768.682/0001-05	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	RENDA FIXA	IMA-B	20,33%	20.000.000	1,63595774	1,1 (a)	R\$ 32.719.154,80
								TOTAL	R\$ 160.955.907,69

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

Fonte: Anbima / CVM / Sisprev

2.2. Gráfico 1 - FINANPREV - Carteira de Investimentos

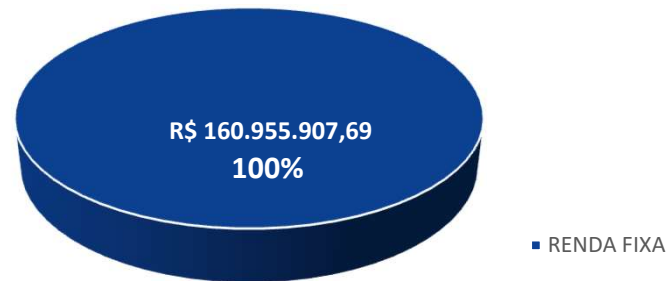
Composição da Carteira



Fonte: Sisprev

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

Composição da Carteira por Segmento



Fonte: Sisprev

3.0. Performance da Carteira (Setembro/2023)

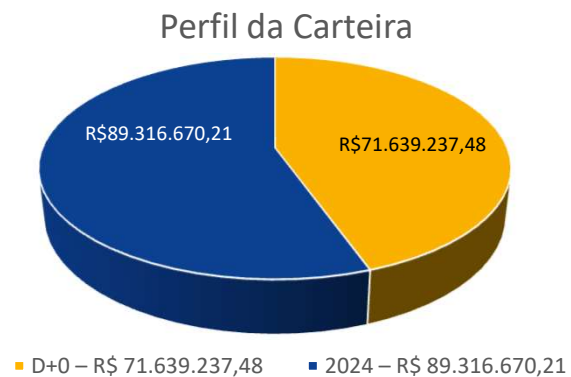
3.1 Tabela 2 - FINANPREV - Performance da Carteira (Setembro/2023)

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	0,97%	0,96%	Não informado
BB RF LP TESOIRO SELIC	SEM CARÊNCIA	2	SELIC	0,97%	0,95%	Não informado
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	16/08/2024	3	IMA-B	-0,95%	1,10%	0,1619%
CAIXA BRASIL 2024 III TP FI RF	16/08/2024	3	IMA-B	-0,95%	1,10%	0,1618%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	16/08/2024	3	IMA-B	-0,95%	1,10%	0,1620%
CAIXA BRASIL 2024 V TP FI RF	16/08/2024	3	IMA-B	-0,95%	1,10%	0,1618%

Fonte: BB/Caixa/CVM/Sisprev

4.0. Horizonte da Carteira (Setembro/2023)

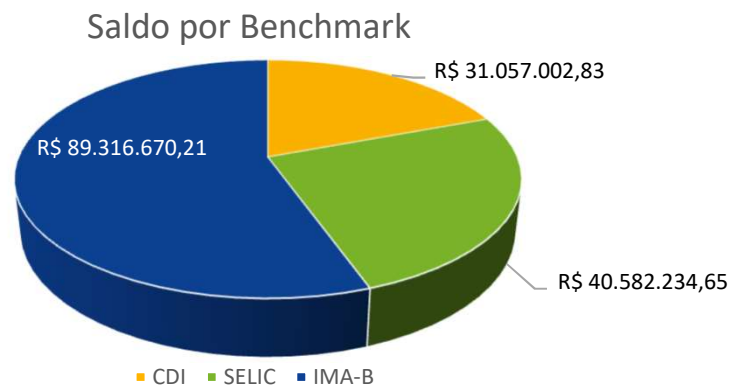
4.1. Gráfico 3 - FINANPREV - Perfil da Carteira



Fonte: Geainv

5.0. Benchmark da Carteira (Setembro/2023)

5.1. Gráfico 4 - FINANPREV - Saldo Por Benchmark



Fonte: Geainv

6.0. Ranking do Administrador e Gestor (Setembro/2023)

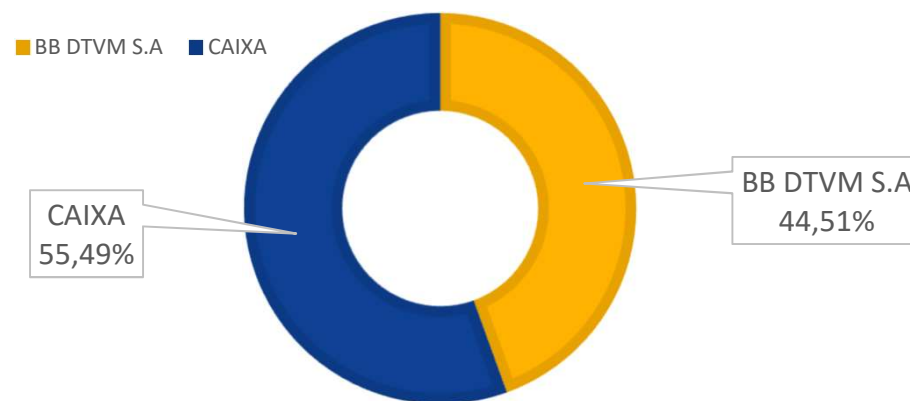
6.1.Tabela 3 - Finanprev - Ranking do Administrador e do Gestor dos fundos aplicados.

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	44,51%	R\$ 71.639.237,48
CAIXA	5	CAIXA ASSET	4	55,49%	R\$ 89.316.670,21
				TOTAL	100% R\$ 160.955.907,69

Nota (a): Ranking referente ao mês de agosto de 2023.

Fonte: CVM / Sisprev

6.5 Gráfico 5- Finanprev - Saldo Por Benchmark



Fonte: Sisprev

7.0. Enquadramentos da Carteira (Setembro/2023)

7.1 Tabela 4 - FINANPREV - Enquadramentos (Setembro/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\$ 31.057.002,83	19,2953%
BB RF LP TESOIRO SELIC	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 40.582.234,65	25,2133%
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI RF	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 9.141.290,95	5,6794%
CAIXA BRASIL 2024 III TP FI RF	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 3.628.475,76	2,2543%
CAIXA BRASIL 2024 IV TP FI RF	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 43.827.748,70	27,2297%
CAIXA BRASIL 2024 V TP FI RF	ARTIGO 7, INCISO I 'B'	R\$ 32.719.154,80	20,3280%
	TOTAL	R\$ 160.955.907,69	100%

Fonte: Geainv

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

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

TIPO	SEGMENTO	RESOLUÇÃO	P.A.I	ALOCAÇÃO
Fundos de Índice Renda Fixa	RENDA FIXA	60%	60%	19%
Fundos 100% TPF	RENDA FIXA	100%	100%	81%

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 (Setembro/2023)

9.1. Tabela 6 - FINANPREV - Composição da Carteria por Instituidor (Setembro/2023)

INSTITUIÇÃO	TOTAL APLICADO	%
Banco do Brasil S.A.	R\$ 71.639.237,48	45%
Caixa Econômica Federal	R\$ 89.316.670,21	55%
Total	R\$ 160.955.907,69	100%

Fonte: Sisprev

10.0. Evolução do Patrimônio

10.1. Tabela 7 - FINANPREV - Evolução do Patrimônio

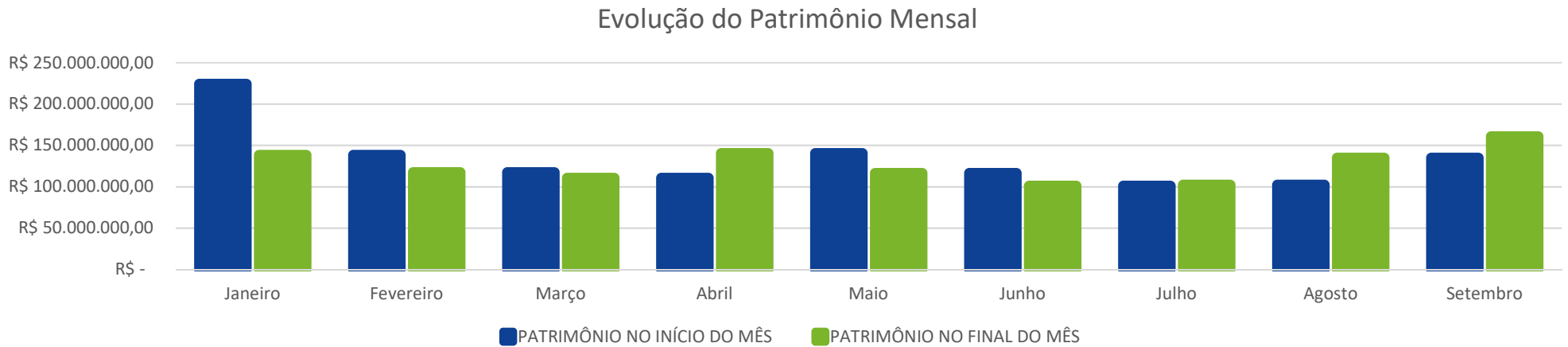
MÊS	PATRIMÔNIO INICIAL	APLICAÇÕES	RESGATES	AMORTIZAÇÃO (a)	RENTABILIDADE CARTEIRA	PATRIMÔNIO FINAL
Janeiro (c)	R\$ 224.438.145,79	R\$ 26.151.086,96	R\$ 114.911.364,32	R\$ -	R\$ 2.621.812,92	R\$ 138.299.681,35
Fevereiro	R\$ 138.299.681,35	R\$ 41.704.070,21	R\$ 61.853.097,80	-R\$ 2.543.268,58	R\$ 1.706.146,00	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
Maiο	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	R\$ 116.505.731,93	R\$ 32.000.000,00	R\$ 48.500.000,00	R\$ -	R\$ 1.236.527,94	R\$ 101.242.259,87
Julho	R\$ 101.242.259,87	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.069.668,88	R\$ 102.311.928,75
Agosto	R\$ 102.311.928,75	R\$ 51.700.000,00	R\$ 18.000.000,00	-R\$ 2.313.098,36	R\$ 1.203.214,70	R\$ 134.902.045,09
Setembro	R\$ 134.902.045,09	R\$ 44.500.000,00	R\$ 20.000.000,00	R\$ -	R\$ 1.553.862,60	R\$ 160.955.907,69
Outubro						
Novembro						
Dezembro						
Total		R\$ 333.533.332,77	R\$ 404.793.339,73	-R\$ 4.856.366,94	R\$ 15.177.404,38 (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.

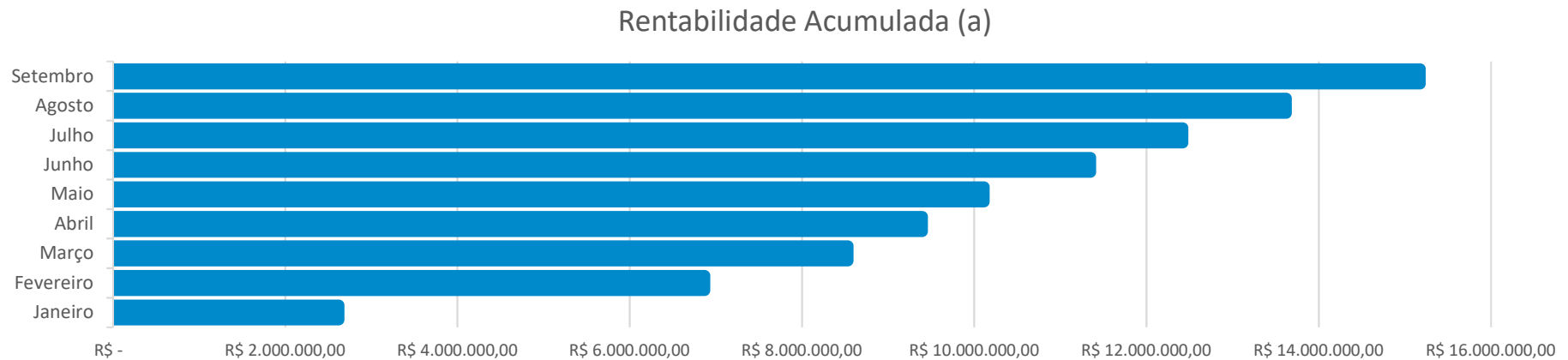
10.2.Gráfico 7 - FINANPREV - Evolução do Patrimônio



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

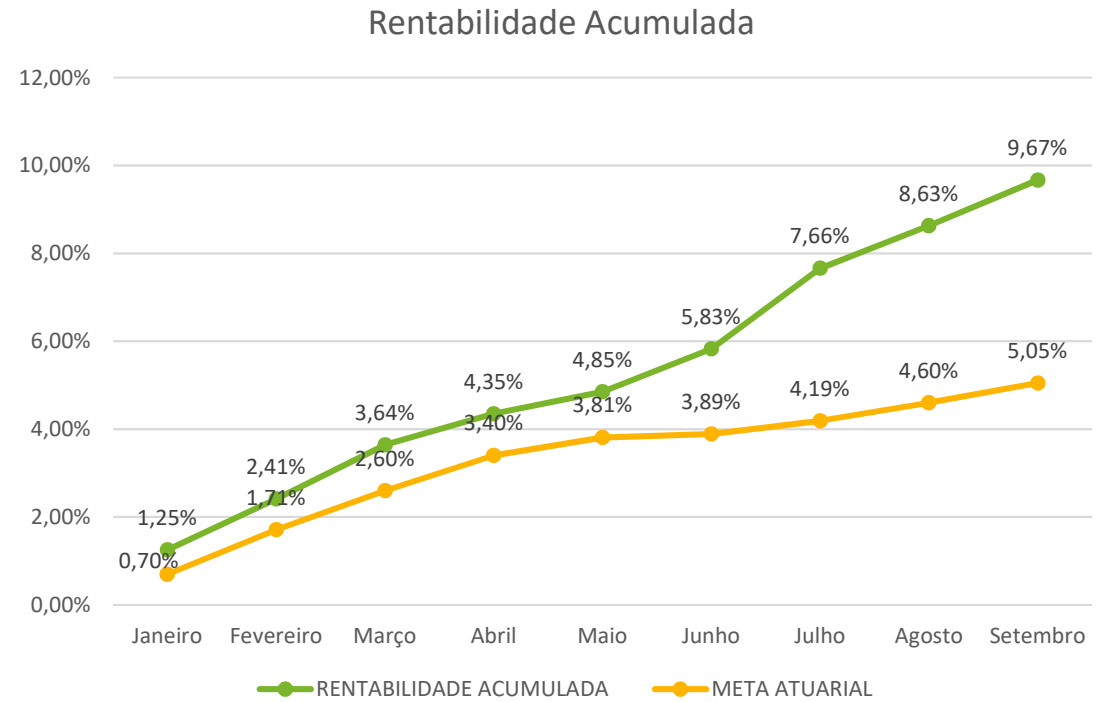
11.0. Rentabilidade da Carteira

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%
Mai	0,48%	4,85%	3,81%
Junho	0,98%	5,83%	3,89%
Julho	1,06%	7,66%	4,19%
Agosto	0,96%	8,63%	4,60%
Setembro	1,04%	9,67%	5,05%
Outubro			
Novembro			
Dezembro			

Fonte: Sisprev

8.2. Gráfico 9 - FINANPREV - Rentabilidade Acumulada



Fonte: Sisprev