



Relatório de Investimento

Anual - 2023




SECRETARIA DE ESTADO
DA ADMINISTRAÇÃO




SERGIPE
GOVERNO DO ESTADO

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	13.897.678,18	10,83%	11.119.001.429,69	0,12%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.338.567,50	7,28%	499.145.687,94	1,87%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.706.697,50	2,89%	56.325.979,84	6,58%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	44.774.672,62	34,90%	3.886.422.398,07	1,15%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	33.424.144,80	26,06%	193.096.297,69	17,31%	7º I b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	23.140.631,78	18,04%	16.475.113.370,57	0,14%	7º III a

Investimentos
 128.282.392,38

Disponibilidades Financeiras
 25.403.603,32

Total Carteira
 153.685.995,70

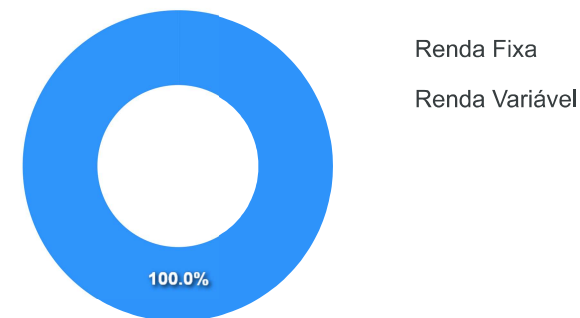
Governança (Pró Gestão)
 NIVEL 3 23/11/2024

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	81,96%	105.141.760,60 18,04%
7º III a - FI Referenciados RF	75,00%	18,04%	23.140.631,78 56,96%

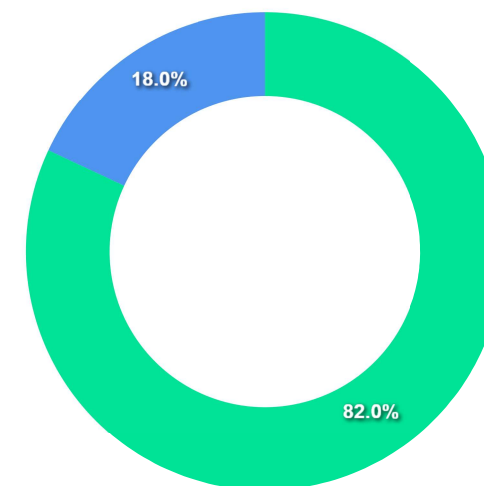
Governança (Pró Gestão)

🔗 NIVEL 3 23/11/2024

Segmentos



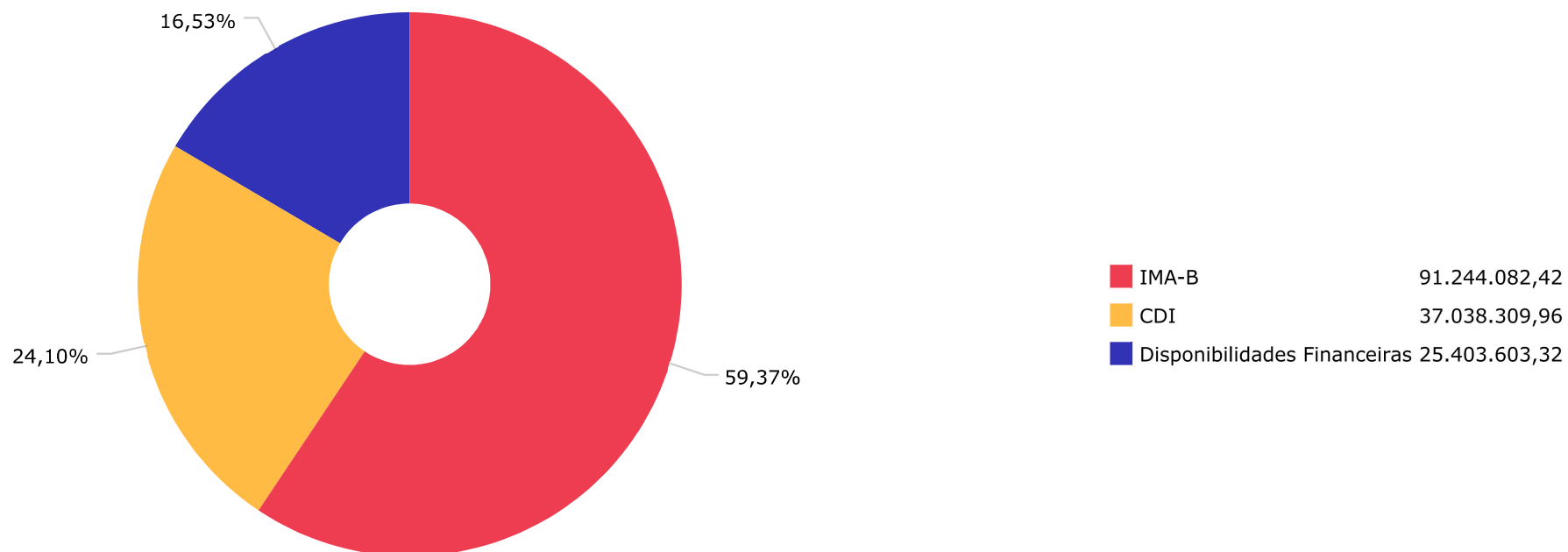
Artigos

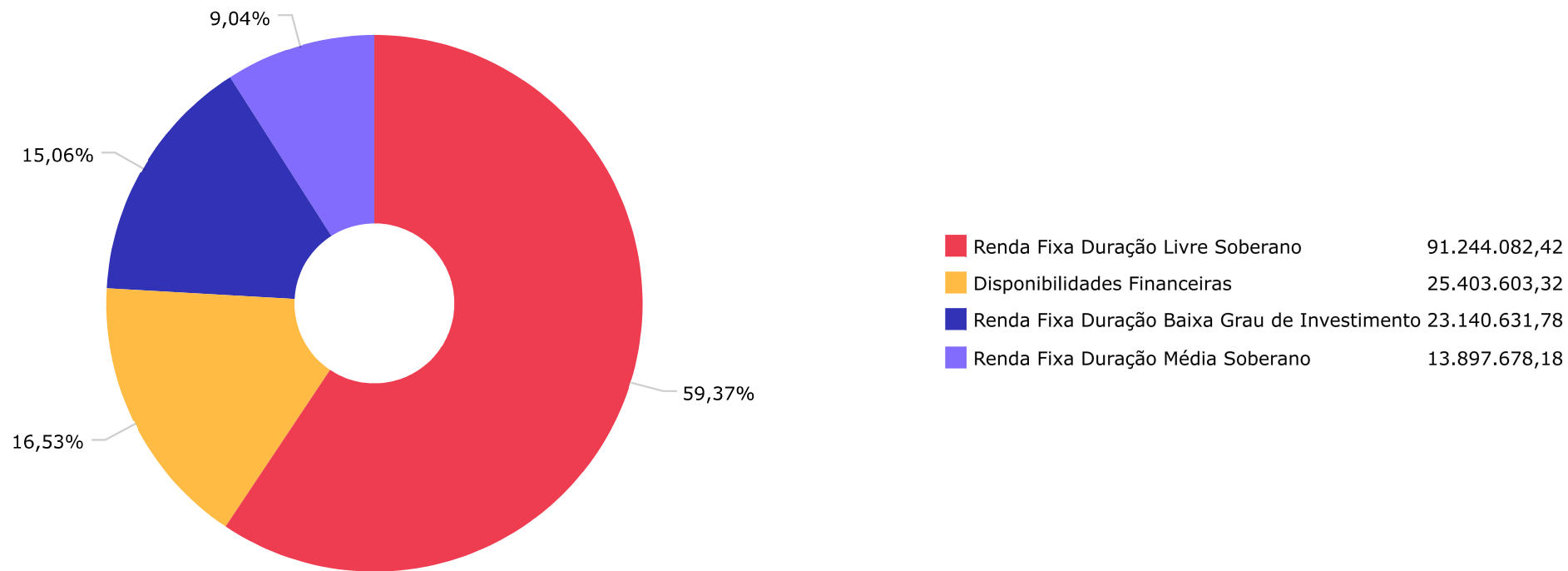


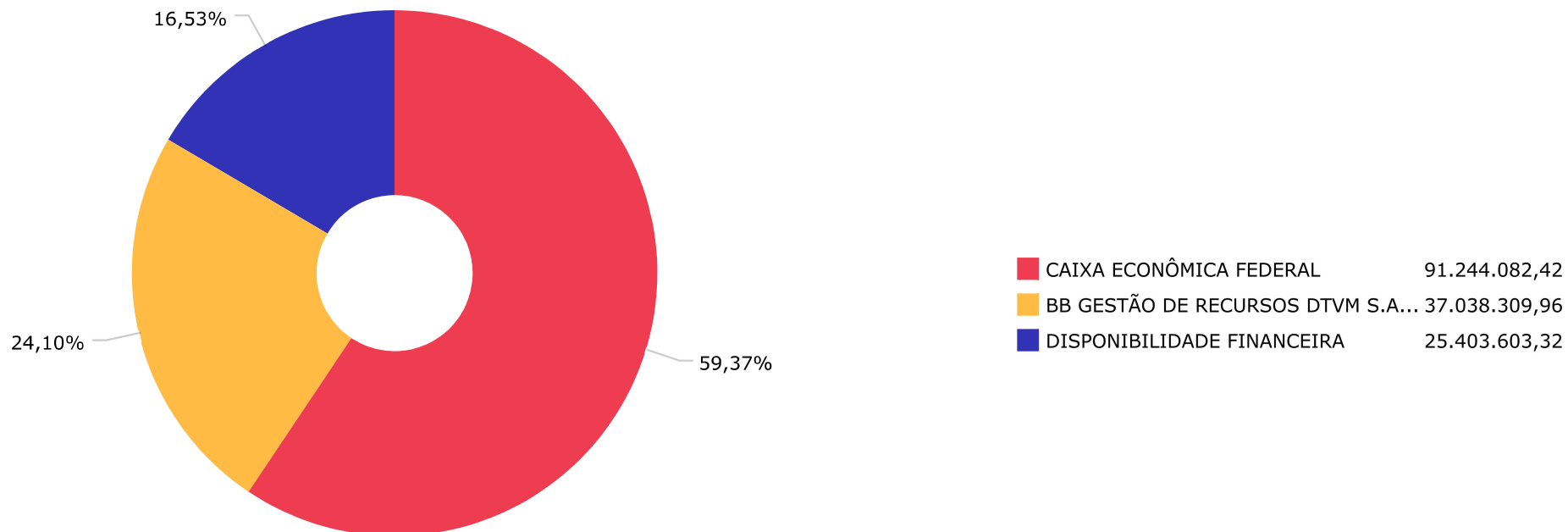
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I b - FI 100% Títulos TN	81,96%	25,00%	70,00%	100,00%	23.140.631,78
7° III a - FI Referenciados RF	18,04%	10,00%	25,00%	60,00%	53.828.803,65

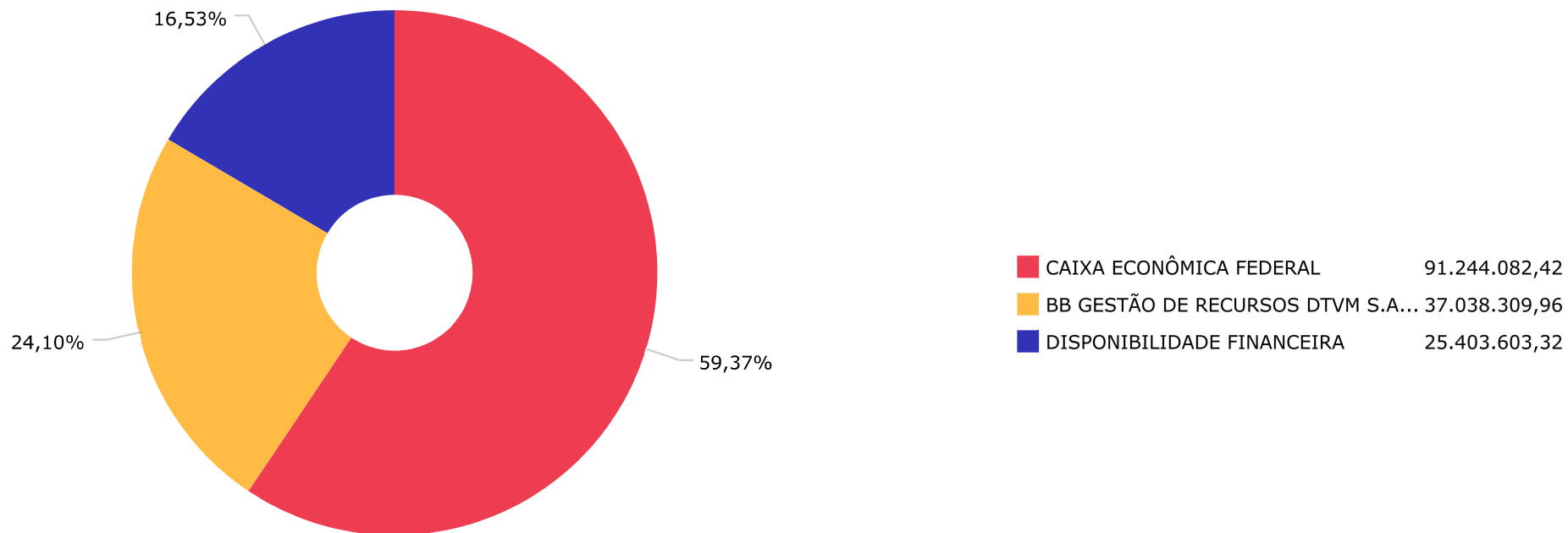
Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8° I - Fundos de Ações	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	32.070.598,10

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CDI - BENCHMARK	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03		
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,90	12,98	2,83	6,15	12,98	27,20	0,01	0,02
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	0,88	12,75	2,75	5,99	12,75	26,46	0,01	0,02
IMA-B - BENCHMARK	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45		
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92	5,28	2,15	2,64	5,28	8,47	0,34	0,71
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92	5,25	2,16	2,66	5,25	8,49	0,34	0,71
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92	5,19	2,16	2,62	5,19	8,46	0,34	0,71
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92	5,16	2,16	2,60	5,16	8,48	0,34	0,71









Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	224.438.145,79	29.600.597,91	118.362.451,28	138.299.681,35	2.623.388,93	2.623.388,93	1,17% ▲	1,17%	0,70%	0,70%	167,14%	0,59%
Fevereiro	138.299.681,35	52.647.338,79	75.347.212,79	117.313.531,18	1.713.723,83	4.337.112,76	1,24% ▲	2,42%	0,98%	1,69%	143,20%	3,78%
Março	117.313.531,18	42.600.000,00	51.000.000,00	110.575.122,22	1.661.591,04	5.998.703,80	1,42% ▲	3,87%	0,89%	2,60%	148,85%	0,72%
Abril	110.575.122,22	60.406.175,60	31.256.175,60	140.588.463,21	863.340,99	6.862.044,79	0,62% ▲	4,51%	0,75%	3,37%	133,83%	0,35%
Mai	140.588.463,21	34.600.000,00	59.400.877,61	116.505.731,93	718.146,33	7.580.191,12	0,51% ▲	5,05%	0,40%	3,79%	133,25%	0,39%
Junho	116.505.731,93	32.000.000,00	48.500.000,00	101.242.259,87	1.236.527,94	8.816.719,06	1,06% ▲	6,16%	0,09%	3,88%	158,76%	0,41%
Julho	101.242.259,87	0,00	0,00	102.311.928,75	1.069.668,88	9.886.387,94	1,06% ▲	7,29%	0,29%	4,17%	174,82%	0,37%
Agosto	102.311.928,75	51.700.000,00	20.313.098,36	134.902.045,09	1.203.214,70	11.089.602,64	0,90% ▲	8,25%	0,41%	4,60%	179,35%	2,65%
Setembro	134.902.045,09	44.500.000,00	20.000.000,00	160.955.907,69	1.553.862,60	12.643.465,24	0,97% ▲	9,31%	0,42%	5,04%	184,72%	0,19%
Outubro	160.955.907,69	30.000.000,00	80.000.000,00	111.997.501,00	1.041.593,31	13.685.058,55	0,65% ▲	10,01%	0,41%	5,47%	183,00%	0,39%
Novembro	111.997.501,00	35.000.000,00	31.000.000,00	117.063.358,25	1.065.857,25	14.750.915,80	0,92% ▲	11,02%	0,44%	5,93%	185,83%	0,23%
Dezembro	117.063.358,25	85.003.664,74	75.003.664,74	128.282.392,38	1.219.034,13	15.969.949,93	0,96% ▲	12,09%	0,72%	6,69%	180,72%	0,24%

Retorno Acumulado (Períodos)

Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	5.998.703,80	3,87%	2,60%
2º Trim	2.818.015,26	2,21%	1,24%
1º Sem	8.816.719,06	6,16%	3,88%
3º Trim	3.826.746,18	2,96%	1,12%
4º Trim	3.326.484,69	2,55%	1,57%
2º Sem	7.153.230,87	5,58%	2,71%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

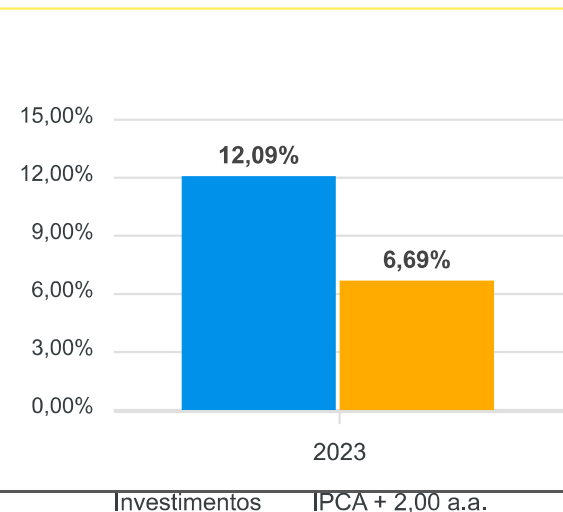


Gráfico Risco x Retorno

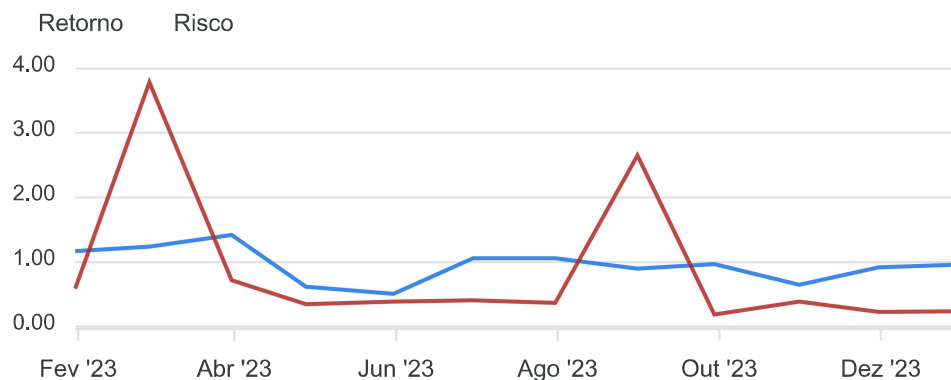
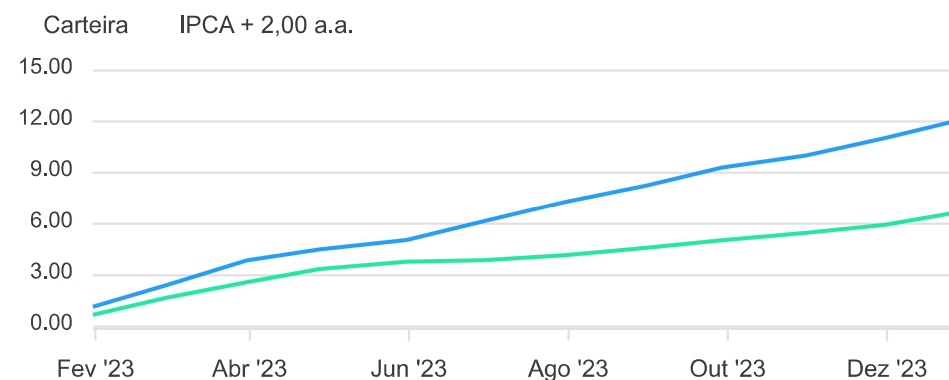
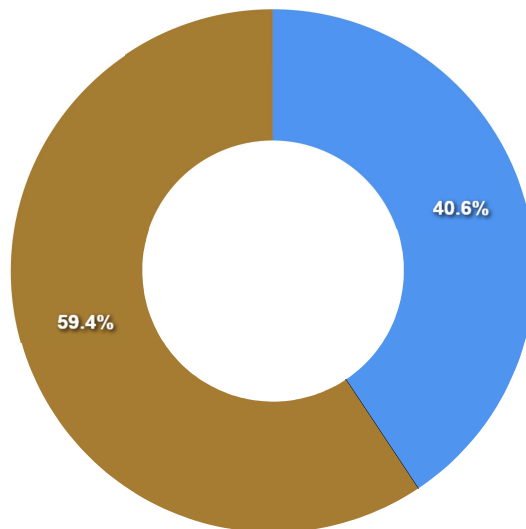


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 29/12/2023

Disponibilidade	Valor	%
Até D+30	62.441.913,28	48,68
Até D+180	0,00	0,00
Até D+360	91.244.082,42	71,13
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



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	22.793.365,11	75.000.002,92	75.000.000,00	23.140.631,78	347.263,75	0,36% ▲	0,01%
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	3.859.511,11	10.000.000,00	0,00	13.897.678,18	38.167,07	0,28% ▲	0,01%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.253.250,35	0,00	0,00	9.338.567,50	85.317,15	0,92% ▲	0,34%
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.672.864,24	0,00	0,00	3.706.697,50	33.833,26	0,92% ▲	0,34%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	44.365.176,84	0,00	0,00	44.774.672,62	409.495,78	0,92% ▲	0,34%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	33.119.190,60	0,00	0,00	33.424.144,80	304.954,20	0,92% ▲	0,34%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	3.661,82	3.664,74	0,00	2,92	0,08% ▲	0,01%
	117.063.358,25	85.003.664,74	75.003.664,74	128.282.392,38	1.219.034,13	0,96%	0,24%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	3.661,82	3.664,74	0,00	2,92	0,08% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	31.057.002,83	139.000.002,92	148.000.000,00	23.140.631,78	1.083.626,03	0,64% ▲
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	40.582.234,65	11.000.000,00	38.000.000,00	13.897.678,18	315.443,53	0,61% ▲
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.141.290,95	0,00	0,00	9.338.567,50	197.276,55	2,16% ▲
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.628.475,76	0,00	0,00	3.706.697,50	78.221,74	2,16% ▲
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	43.827.748,70	0,00	0,00	44.774.672,62	946.923,92	2,16% ▲
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.719.154,80	0,00	0,00	33.424.144,80	704.990,00	2,15% ▲
	160.955.907,69	150.003.664,74	186.003.664,74	128.282.392,38	3.326.484,69	2,07%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	14.524.441,35	14.533.773,71	0,00	9.332,36	0,06% ▲
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	38.702.427,81	388.705.160,09	408.581.097,80	23.140.631,78	4.314.141,68	1,01% ▲
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	99.012.712,02	94.828.175,60	182.212.241,93	13.897.678,18	2.269.032,49	1,17% ▲
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.877.577,65	0,00	498.784,66	9.338.567,50	959.774,51	10,81% ▲
CAIXA BRASIL 2024 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.521.955,16	0,00	195.449,63	3.706.697,50	380.191,97	10,79% ▲
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	42.577.041,15	0,00	2.410.403,85	44.774.672,62	4.608.035,32	10,82% ▲
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.746.432,00	0,00	1.751.728,80	33.424.144,80	3.429.441,60	10,80% ▲
	224.438.145,79	498.057.777,04	610.183.480,38	128.282.392,38	15.969.949,93	7,12%

Cenário Econômico

Assim como o mês de novembro, dezembro foi mais um mês positivo para as carteiras de investimentos, mais uma vez beneficiado pelo bom desempenho da renda variável local e repetindo o movimento anterior, mais um mês de fechamento na curva de juros, que beneficiaram os fundos atrelados a inflação, e não muito diferente os fundos de investimentos ligados a ativos no exterior tiveram mais um mês de desempenho positivo.

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 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 não foram atingidos diante das oportunidades que o mercado ofereceu como boas alternativas.

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 mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos da política de investimentos, 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, estão presentes na lista exaustiva da SPREV, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

No segmento de renda fixa, o fechamento da curva de juros continuou alavancando os resultados tanto dos fundos ligados a inflação, assim como dos fundos de defesa. No segmento de renda variável as carteiras foram beneficiadas pelo forte desempenho dos fundos ligados à bolsa brasileira. E por fim os fundos no exterior também tiveram um desempenho positivo pelo avanço do mercado americano.

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, 16 de janeiro de 2024.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
103.817

Patrimônio Líquido Fundo
11.119.001.429,69

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
CDI

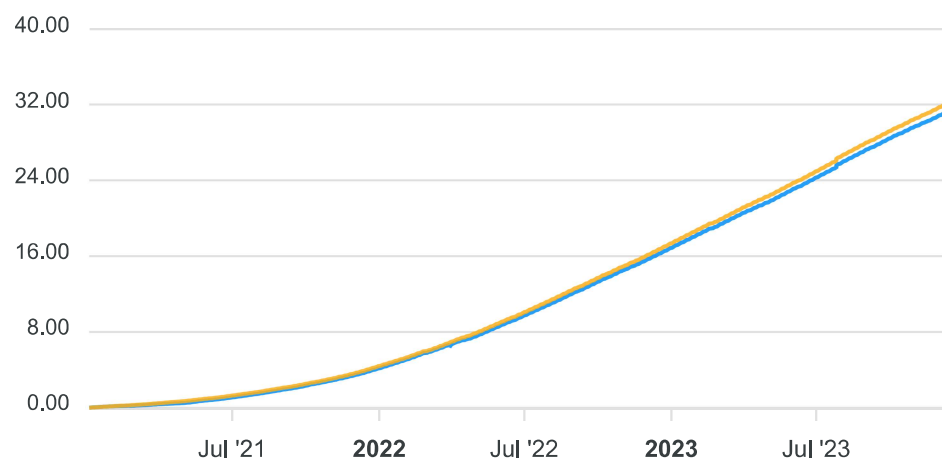
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Média Soberano

Política de Investimento
Aloca seus recursos em ativos e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro, utilizando-se de cotas de fundos de investimento que apresentem carteira com prazo médio superior a 365 dias.

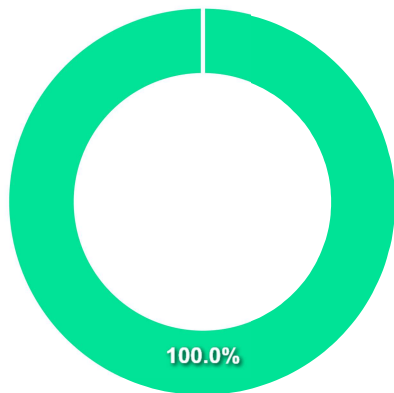
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,88%	12,75%	2,75%	5,99%	12,75%	26,46%	0,01%	0,02%
Benchmark	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB ATACADO FEDERAL FI RENDA FIXA LP	11.360.286,02	100,00	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	114,13	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	36,96	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	30,73	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IOF_a_recolher	6,89	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,65	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste_Cota_Pos	0,13	0,00	Outros
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	-90,16	0,00	Outros
Valores a pagar / IR_a_recolher	-107,41	0,00	Outros

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	11.360.286,02	100.00%
Valores a pagar/receber	182,46	0.00%
Outros	-190,56	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
105

Patrimônio Líquido Fundo
499.145.687,94

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

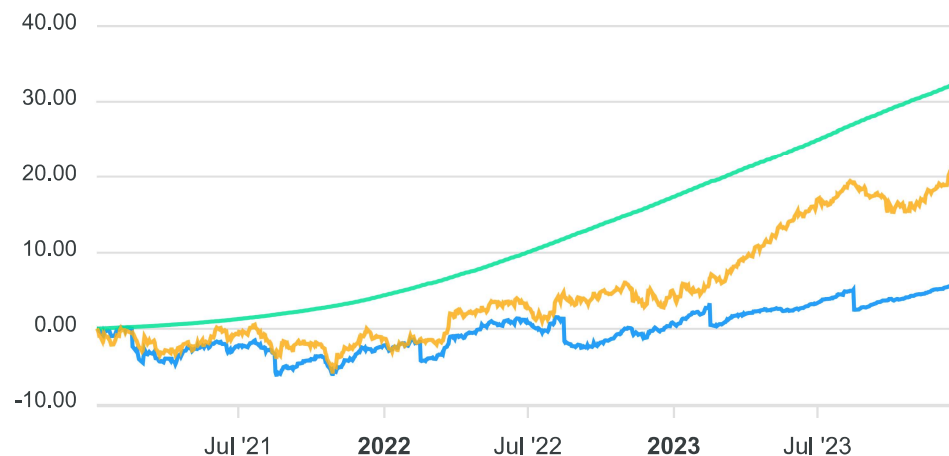
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós fixadas e/ou índices de preços.

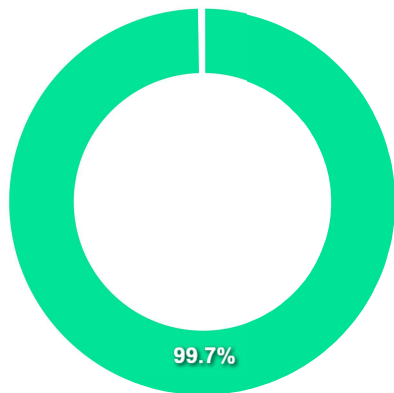
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,92%	5,19%	2,16%	2,62%	5,19%	8,46%	0,34%	0,71%
Benchmark	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	505.793,91	99,73	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	1.338,56	0,26	Operação compromissada
Outros Valores a receber	23,84	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	11,06	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-26,17	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	505.793,91	99.73%
Operação compromissada	1.338,56	0.26%
Valores a pagar/receber	8,73	0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
21

Patrimônio Líquido Fundo
56.325.979,84

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

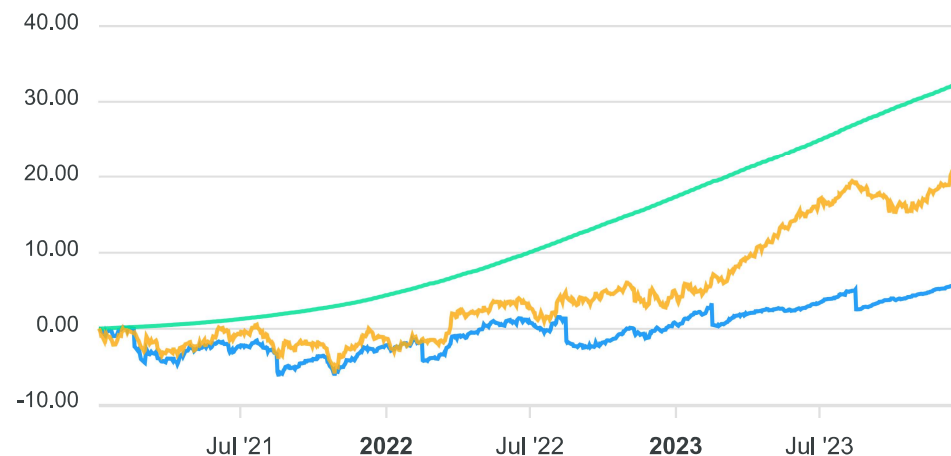
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas pré-fixadas, pós- fixadas e/ou índices de preços. Não realiza operações de day-trade.

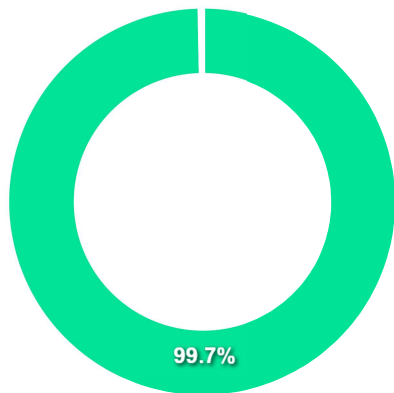
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,92%	5,25%	2,16%	2,66%	5,25%	8,49%	0,34%	0,71%
Benchmark	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	57.035,22	99,70	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	154,17	0,27	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	11,81	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	7,45	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-4,11	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	57.035,22	99.70%
Operação compromissada	154,17	0.27%
Valores a pagar/receber	15,15	0.03%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
305

Patrimônio Líquido Fundo
3.886.422.398,07

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos em um único ativo, uma NTN-B com vencimento em 2024.

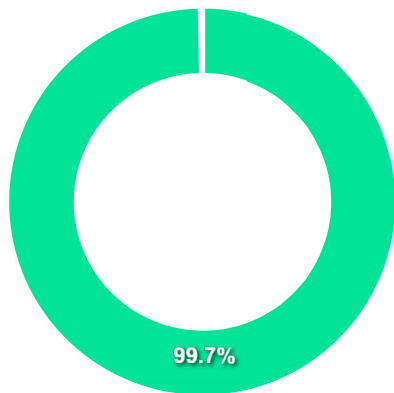
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,92%	5,16%	2,16%	2,60%	5,16%	8,48%	0,34%	0,71%
Benchmark	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	3.970.912,83	99,73	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2026	10.969,25	0,28	Operação compromissada
Outros Valores a receber	33,52	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	10,93	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-179,49	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.970.912,83	99.73%
Operação compromissada	10.969,25	0.28%
Valores a pagar/receber	-135,03	-0.00%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
26

Patrimônio Líquido Fundo
193.096.297,69

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark
IMA-B

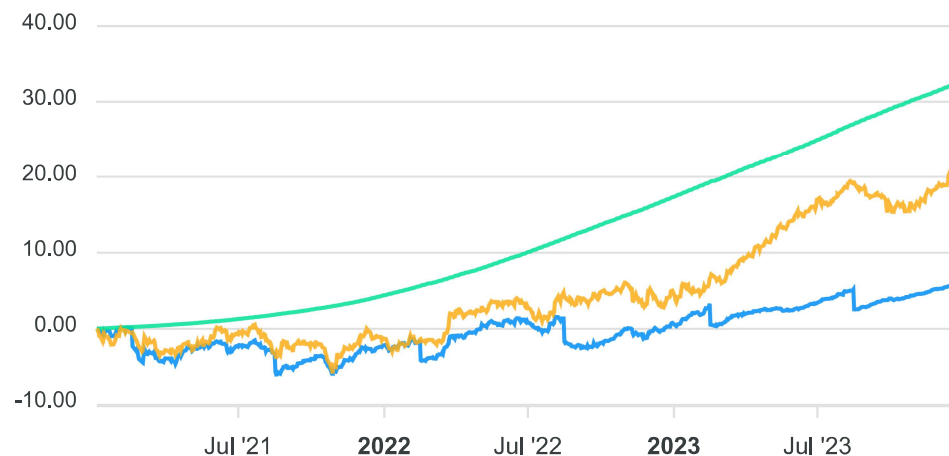
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento
Aplica seus recursos em títulos públicos federais.

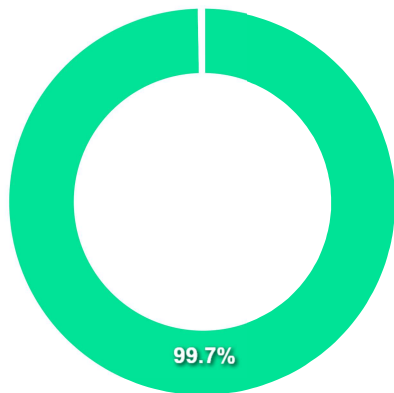
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,92%	5,28%	2,15%	2,64%	5,28%	8,47%	0,34%	0,71%
Benchmark	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%		
CDI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	195.595,68	99,72	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	536,49	0,27	Operação compromissada
Outros Valores a receber	17,88	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	11,32	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-12,03	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	195.595,68	99.72%
Operação compromissada	536,49	0.27%
Valores a pagar/receber	17,17	0.01%

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

Administrador
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração
0,20%

Taxa de Performance
Não possui

Disponibilidade de Resgate
D+0

Quantidade de Cotistas
1.133

Patrimônio Líquido Fundo
16.475.113.370,57

PERFIL DO FUNDO

Enquadramento Resolução
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark
CDI

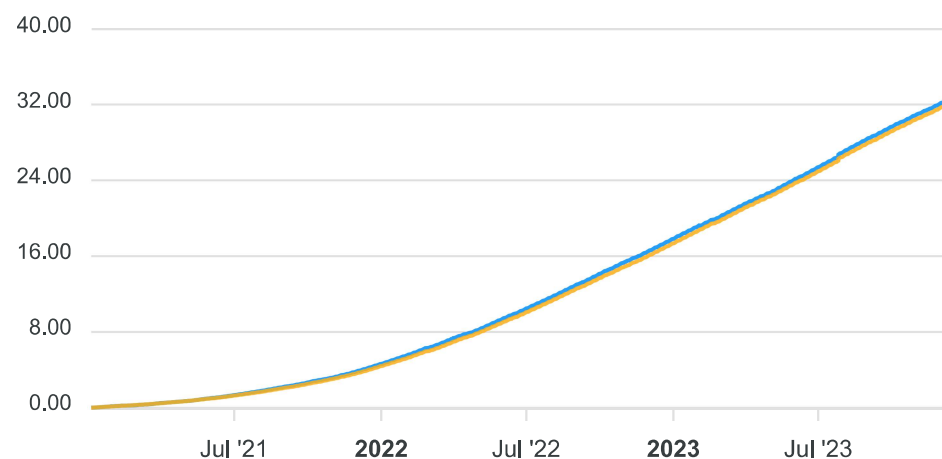
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

Política de Investimento
Investe, no mínimo, 80% de sua carteira em cotas de fundo investimento cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

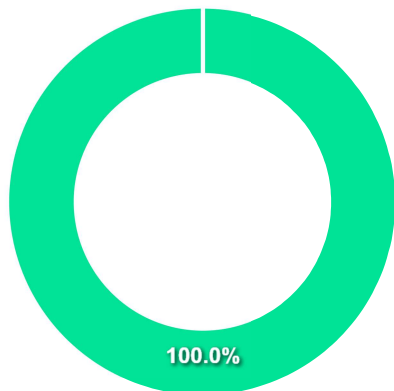
COMPARATIVO

📅 29/12/2023

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,90%	12,98%	2,83%	6,15%	12,98%	27,20%	0,01%	0,02%
Benchmark	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%		



CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.741.661,71	100,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	36,96	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	30,76	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	6,21	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,10	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste_Cota_Pos	0,03	0,00	Outros
Valores a pagar / IR_a_recolher	0,00	0,00	Outros
Valores a pagar / IOF_a_recolher	0,00	0,00	Outros
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa_Adm_a_Pagar	-140,81	0,00	Outros

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	17.741.661,71	100.00%
Valores a pagar/receber	74,02	0.00%
Outros	-140,77	-0.00%

Parecer do Comitê de Investimento

O Comitê de Investimentos do **INST PREV SEVID ESTADO SERGIPE - SERGIPEPREVIDENCIA - SE** analisou o relatório de investimentos referente ao mês **Dezembro/2023**, atestando os dados relativos à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

Aprovação do Conselho Fiscal

O Conselho Fiscal do **INST PREV SEVID ESTADO SERGIPE - SERGIPEPREVIDENCIA - SE** analisou, conferiu e aprovou o relatório de investimentos, referente ao mês **Dezembro/2023** bem como o parecer do Comitê de Investimentos, que tratam do acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do **INST PREV SEVID ESTADO SERGIPE - SERGIPEPREVIDENCIA - SE** e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

