



## Relatório Geral

FUNDO PREVIDENCIARIO DO MUNICIPIO DE  
SAO LOURENCO DA MATA

CNPJ: 08.474.135/0001-09

Referência: Setembro / 2023

## Carteira - Consolidado

Total Carteira: R\$ 14.980.213,54

CNPJ	Produto	Disponib. Resgate	Carência	Saldo	% Sobre Total Côm. Limites	Quantidade Cotistas	% Sobre PL do Fundo	Resolução - 4.963
	Caixa Econômica Federal - Agência: 0876 / Conta:122-0	--	--	0,00	--	--	--	--
	Caixa Econômica Federal - Agência: 0876 / Conta:124-7	--	--	2.000,00	--	--	--	--
	Caixa Econômica Federal - Agência: 0876 / Conta:123-9	--	--	0,00	--	--	--	--
	Caixa Econômica Federal - Agência: 0876 / Conta:151-4	--	--	0,00	--	--	--	--
	Caixa Econômica Federal - Agência: 0876 / Conta:71021-3	--	--	295,28	--	--	--	--
	Banco do Nordeste do Brasil S.A. - Agência: 271 / Conta:4768-2	--	--	0,00	--	--	--	--
	Banco do Nordeste do Brasil S.A. - Agência: 271 / Conta:4975-8	--	--	0,00	--	--	--	--
	Caixa Econômica Federal - Agência: 876 / Conta:600000077-1	--	--	0,00	--	--	--	--
30.068.169/0001-44	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV DE AÇÕES CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	D+15	Não há	600.795,09	4,01%	201	0,09%	ARTIGO 8º, INCISO I
10.740.670/0001-06	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D+0	Não há	3.046.448,51	20,34%	1185	0,04%	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"
30.036.235/0001-02	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	D+1	Não há	340.414,14	2,27%	6682	0,02%	ARTIGO 10º, INCISO I
03737188000143	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	D+3	Não há	608.476,12	4,06%	5458	0,11%	ARTIGO 10º, INCISO I
15154220000147	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+3	Não há	289.071,48	1,93%	5718	0,04%	ARTIGO 8º, INCISO I

00834074000123	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA PRÁTICO RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	0,00	0,00%	15582	0,00%	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"
11060913000110	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	Não há	3.057.894,35	20,42%	933	0,04%	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"
10577503000188	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	Não há	168.841,79	1,13%	291	0,01%	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"
14508605000100	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	D+0	Não há	1.017.732,44	6,79%	426	0,05%	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"
21307581000189	BNB INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	D+0	Não há	469.726,26	3,14%	954	0,10%	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"
03737206000197	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	D+0	Não há	459.483,57	3,07%	985	0,00%	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"
14120520000142	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LONGO PRAZO	D+0	Não há	452.638,65	3,02%	2895	0,03%	ARTIGO 10º, INCISO I
23215097000155	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	D+0	Não há	4.456.370,34	29,75%	794	0,08%	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"
50803936000129	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	10.025,52	0,07%	2870	0,00%	--
			<b>Total:</b>	<b>14.980.213,54</b>	<b>100,00%</b>			

## Títulos Públicos - Consolidado

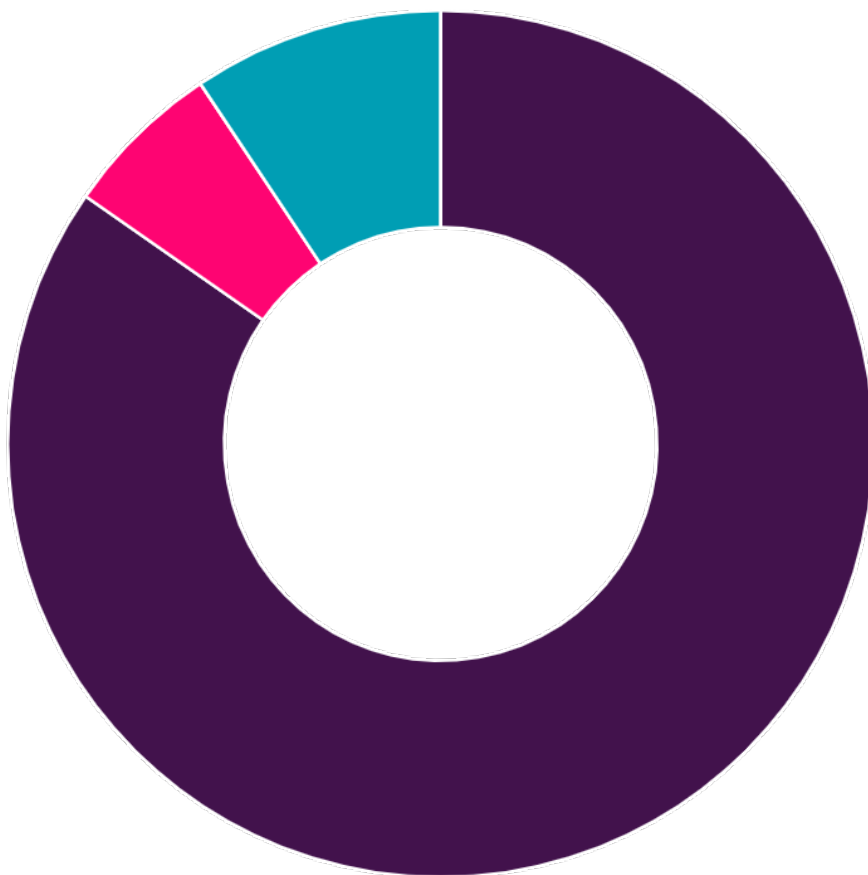
Título / Nota de Negociação	Data Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	Marcação	Valor Compra	Valor Atual
						0,00	0,00

Título / Nota de Negociação	Data Compra	Qtde.	Marcação	Retorno no Mês(\$)	Retorno no Mês(%)	Retorno no Ano(\$)	Retorno no Ano(%)	Retorno desde Início(\$)	Retorno desde Início(%)
				0,00	-	0,00	-	0,00	-

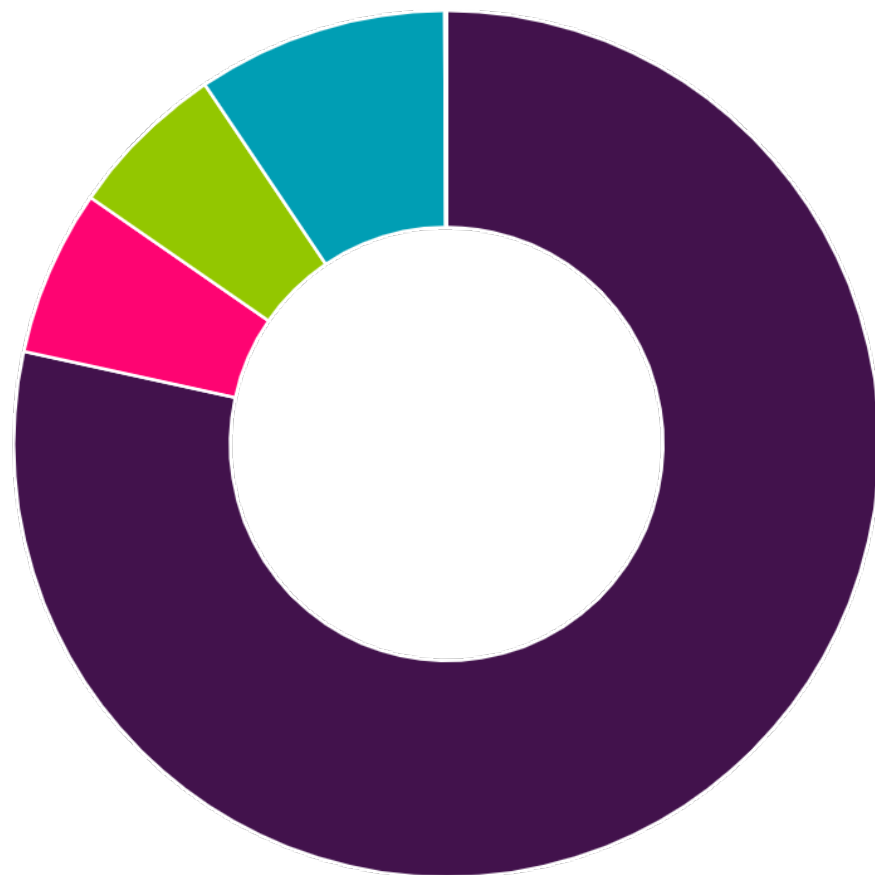




Desenquadrado	Aplicado \$	Aplicado %	Resolução 4.963		Pró-Gestão		Política de Investimento - 2023			Disponível para Aplicar
			Por item %	por Artigo %	Por item %	por Artigo %	Inferior %	Alvo %	Superior %	
Desenquadrado ou Sem Enquadramento	R\$ 10.025,52	0,07%	0,00%	0,00%	-	-	0,00%	0,00%	0,00%	R\$ -10.025,52
<b>Total Desenquadrados</b>	<b>R\$ 10.025,52</b>	<b>0,07%</b>								



Renda Fixa
  Renda Variável
  Renda Exterior



7º I b
  7º III a
  8º I
  10 I
  Sem Enquadramento

## Distribuição - Consolidado

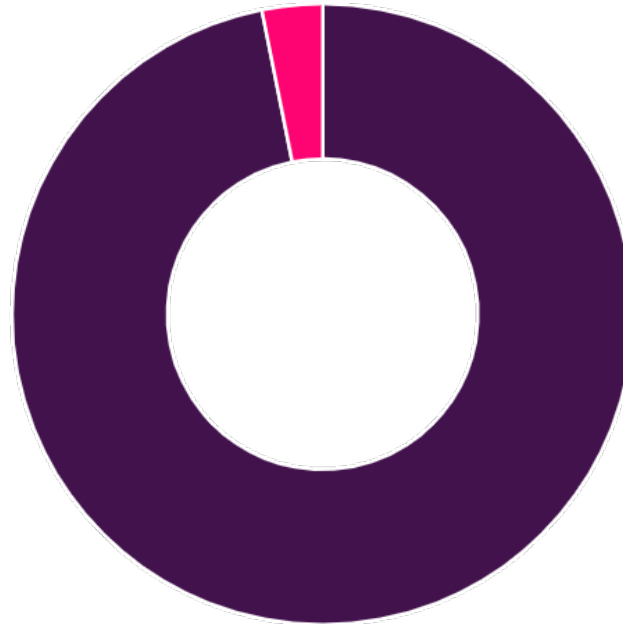
CNPJ	Gestor	Valor	% da Carteira	% em Fundos	PL Gerido Total	% do PL correspondente a investimentos de RPPS
42040639000140	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	14.508.192,00	96,85%	96,86%	501.666.967.532,41	14,58%
07237373000120	BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA	469.726,26	3,14%	3,14%	11.176.018.317,49	1,18%
<b>Total:</b>		<b>14.977.918,26</b>	<b>99,98%</b>	<b>100,00%</b>		

CNPJ	Administrador	Valor	% da Carteira	% em Fundos	PL Administrado Total	% do PL correspondente a investimentos de RPPS
00360305000104	CAIXA ECONOMICA FEDERAL	14.508.192,00	96,85%	96,86%	617.369.312.650,00	12,08%
62318407000119	SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A	469.726,26	3,14%	3,14%	--	--
<b>Total:</b>		<b>14.977.918,26</b>	<b>99,98%</b>	<b>100,00%</b>		

CNPJ	Emissor	Valor	% da Carteira	% em Crédito Privado
<b>Total:</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>

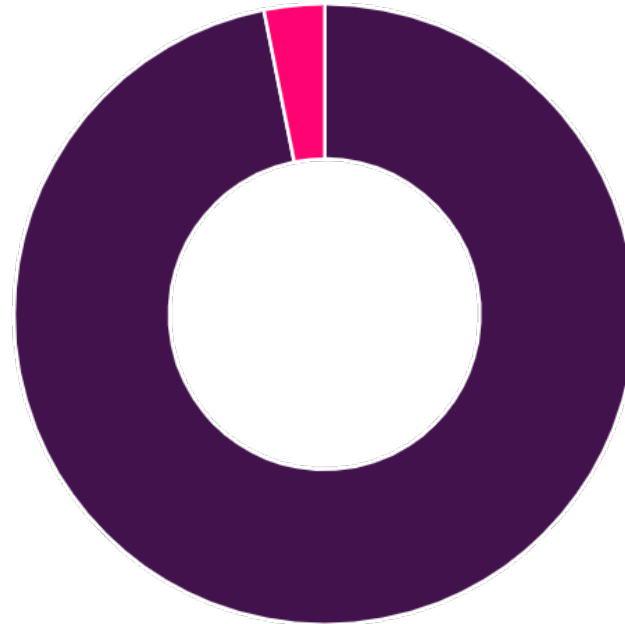


## Distribuição - Gestão



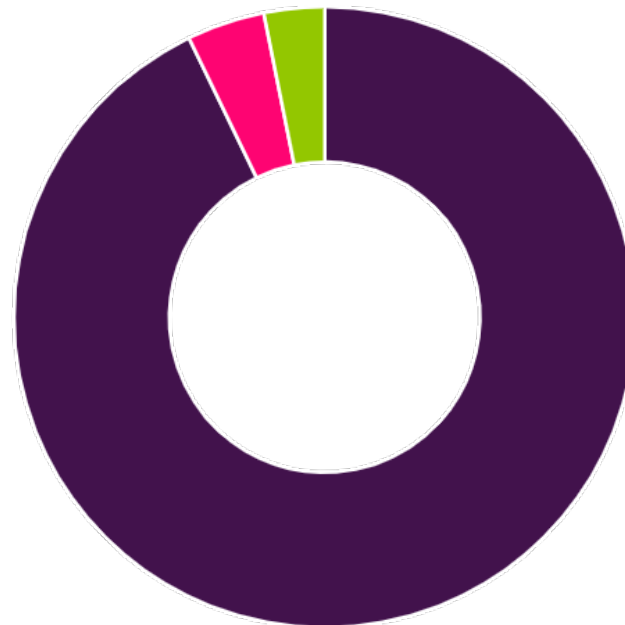
■ CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. ■ BANCO DO NORDESTE DO BRASIL SA

## Distribuição - Administração



■ CAIXA ECONOMICA FEDERAL ■ SANTANDER CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A

## Distribuição - Custódia



■ CAIXA ECONOMICA FEDERAL ■ BANCO BRADESCO S.A. ■ S3 CACEIS BRASIL DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A

## Rentabilidade - Consolidado

### Small Cap

CNPJ	Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm.	VaRMês	Volatilidade - 12 meses
15154220000147	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-2,867 %	4,863 %	-7,236 %	13,753 %	-3,233 %	-21,522 %	1,5 %	2,368 %	20,444 %
--	<b>Small Cap (Benchmark)</b>	<b>-2,855 %</b>	<b>5,027 %</b>	<b>-7,253 %</b>	<b>14,239 %</b>	<b>-2,944 %</b>	<b>-20,826 %</b>	--	--	--

### IRF-M

CNPJ	Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm.	VaRMês	Volatilidade - 12 meses
145086050000100	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,146 %	11,494 %	1,769 %	7,353 %	13,456 %	22,397 %	0,2 %	0,250 %	2,378 %
--	<b>IRF-M (Benchmark)</b>	<b>0,171 %</b>	<b>11,624 %</b>	<b>1,828 %</b>	<b>7,469 %</b>	<b>13,572 %</b>	<b>22,670 %</b>	--	--	--

### IMA-B 5+

CNPJ	Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm.	VaRMês	Volatilidade - 12 meses
105775030000188	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	-1,860 %	11,745 %	-2,383 %	7,906 %	9,747 %	14,997 %	0,2 %	1,010 %	8,449 %
--	<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	<b>-1,923 %</b>	<b>12,080 %</b>	<b>-2,462 %</b>	<b>8,112 %</b>	<b>10,154 %</b>	<b>15,875 %</b>	--	--	--

### IMA-B 5

CNPJ	Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm.	VaRMês	Volatilidade - 12 meses
110609130000110	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,112 %	8,789 %	1,668 %	4,181 %	11,461 %	21,657 %	0,2 %	0,227 %	2,132 %
--	<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	<b>0,133 %</b>	<b>8,890 %</b>	<b>1,727 %</b>	<b>4,220 %</b>	<b>11,646 %</b>	<b>21,970 %</b>	--	--	--

### CDI

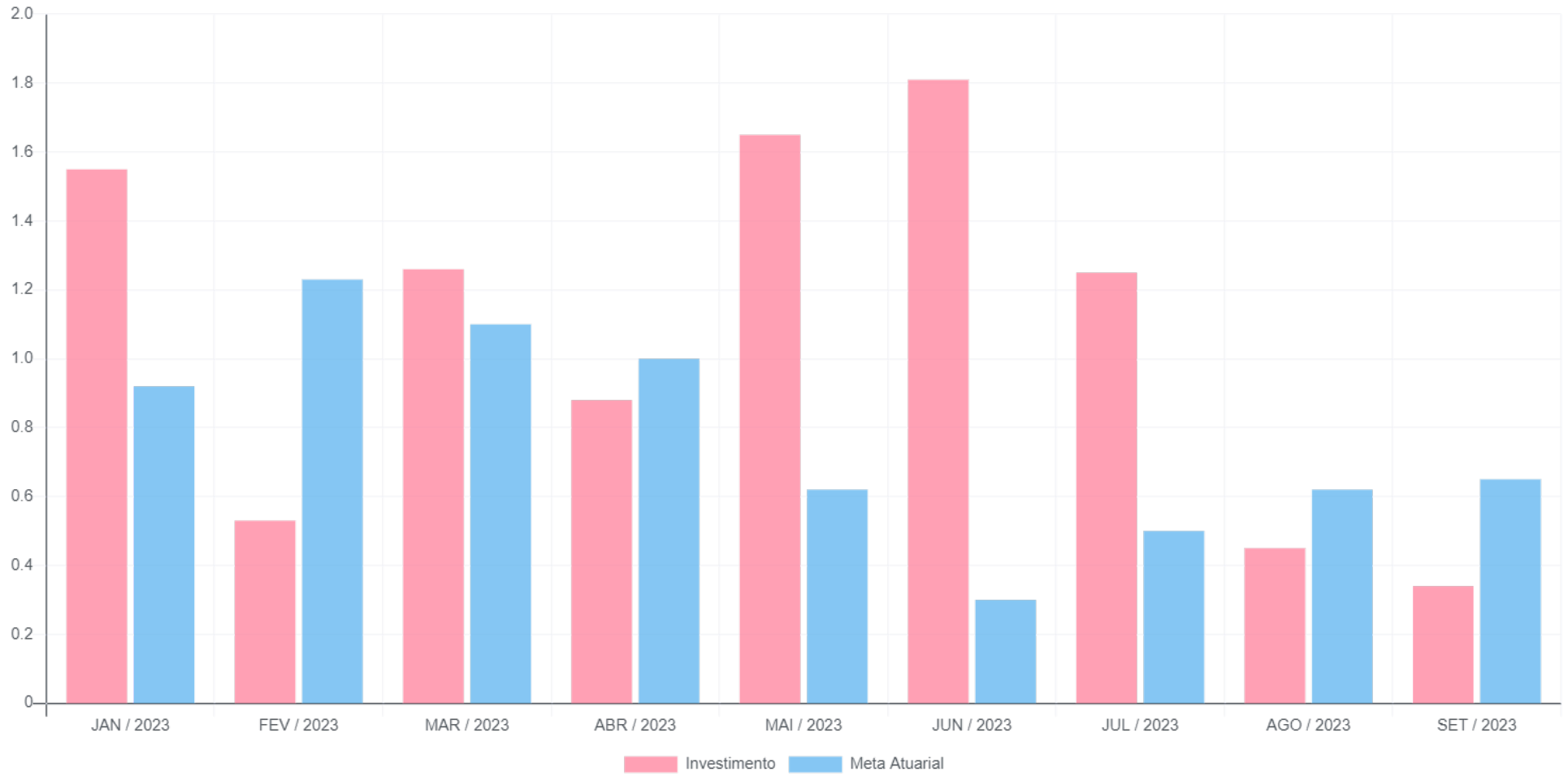
CNPJ	Ativos	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm.	VaRMês	Volatilidade - 12 meses
037372060000197	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	1,026 %	10,087 %	3,443 %	6,862 %	13,670 %	26,382 %	0,2 %	0,047 %	0,033 %
14120520000142	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LONGO PRAZO	0,856 %	9,520 %	2,776 %	6,277 %	12,702 %	26,535 %	0,7 %	0,008 %	0,307 %
213075810000189	BNB INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,988 %	9,858 %	3,210 %	6,489 %	13,330 %	25,658 %	0,35 %	0,043 %	0,060 %
--	<b>CDI (Benchmark)</b>	<b>0,975 %</b>	<b>9,928 %</b>	<b>3,220 %</b>	<b>6,521 %</b>	<b>13,443 %</b>	<b>25,804 %</b>	--	--	--



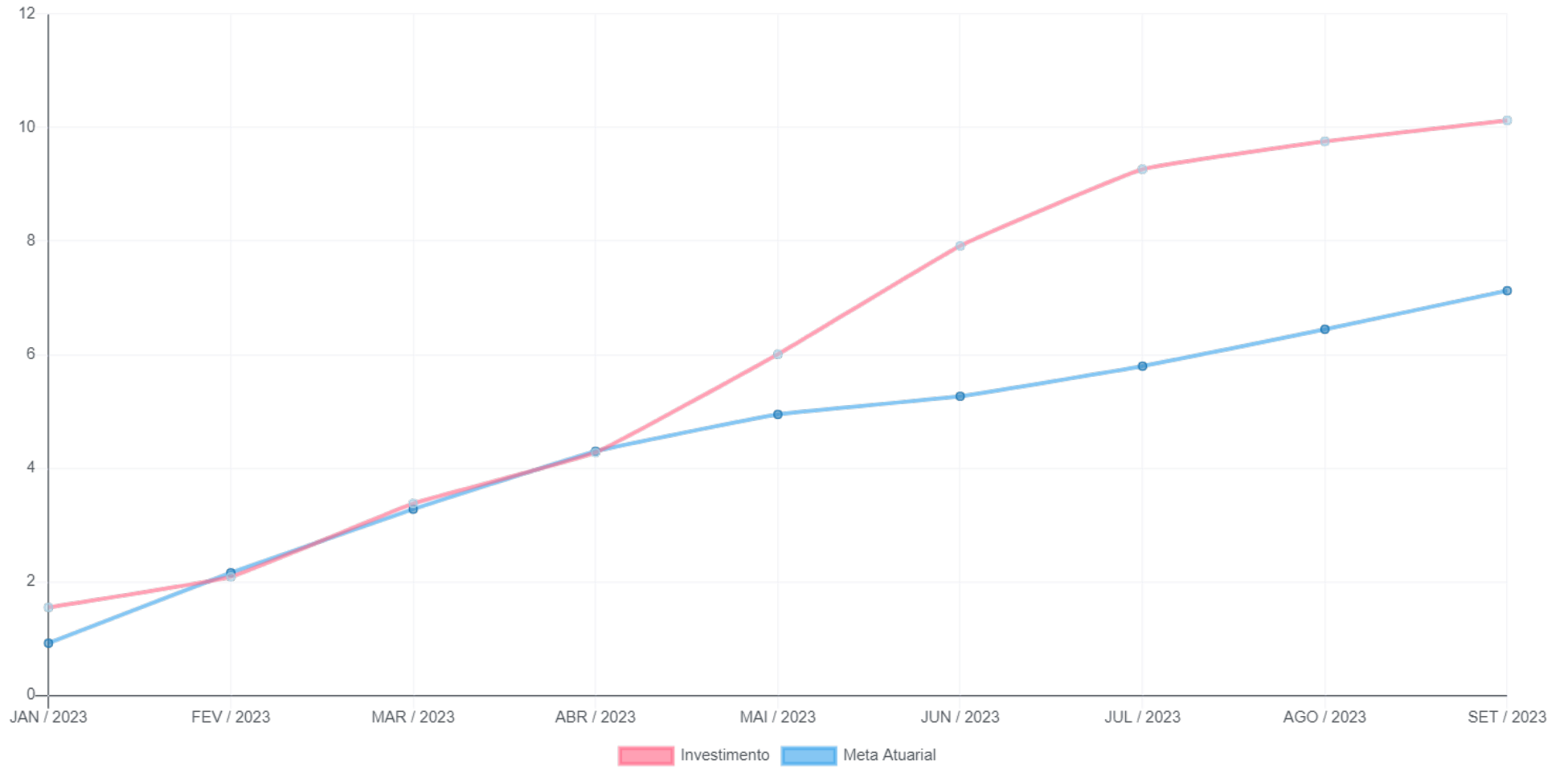
## Retorno - Consolidado

Mês	Saldo Anterior (R\$)	Aplicações (R\$)	Aplicações Acumuladas (R\$)	Resgates / Amortizações (R\$)	Resgates / Amortizações Acumuladas (R\$)	Saldo no Mês (R\$)	Retorno no Mês (R\$)	Retorno Acumulado (R\$)	Retorno no Mês (%)	Retorno Acumulado (%)	Meta para o Mês (R\$)	Meta Acum (R\$)	Meta para o Mês (%)	Meta Acum (%)	Diferença Acumulada (%)
janeiro	17.486.962,72	2.581.903,89	2.581.903,89	2.366.421,63	2.366.421,63	17.976.157,98	273.713,00	273.713,00	1,55%	1,55%	162.209,29	162.209,29	0,92%	0,92%	168,74%
fevereiro	17.976.157,98	3.303.797,82	5.885.701,71	3.337.489,94	5.703.911,57	18.037.886,35	95.420,49	369.133,49	0,53%	2,09%	220.244,01	382.453,29	1,23%	2,16%	96,81%
março	18.037.886,35	2.497.426,39	8.383.128,10	2.388.542,03	8.092.453,60	18.376.092,70	229.321,99	598.455,48	1,26%	3,38%	199.070,40	581.523,69	1,10%	3,28%	103,07%
abril	18.376.092,70	2.380.004,68	10.763.132,78	2.392.286,75	10.484.740,35	18.524.659,95	160.849,32	759.304,80	0,88%	4,28%	183.016,95	764.540,64	1,00%	4,30%	99,46%
maio	18.524.659,95	2.699.441,08	13.462.573,86	2.363.770,49	12.848.510,84	19.172.467,47	312.136,93	1.071.441,73	1,65%	6,01%	116.020,69	880.561,33	0,62%	4,95%	121,45%
junho	19.172.467,47	8.276.644,24	21.739.218,10	9.327.056,56	22.175.567,40	18.449.350,14	327.294,99	1.398.736,72	1,81%	7,92%	55.084,89	935.646,22	0,30%	5,27%	150,45%
julho	18.449.350,14	6.579.620,92	28.318.839,02	7.755.933,77	29.931.501,17	17.488.088,24	215.050,95	1.613.787,67	1,25%	9,27%	87.182,99	1.022.829,21	0,50%	5,80%	159,84%
agosto	17.488.088,24	2.459.223,99	30.778.063,01	3.625.193,02	33.556.694,19	16.395.231,29	73.112,08	1.686.899,75	0,45%	9,76%	100.406,70	1.123.235,91	0,62%	6,45%	151,30%
setembro	16.395.231,29	1.554.774,84	32.332.837,85	3.023.314,91	36.580.009,10	14.977.918,26	51.227,04	1.738.126,79	0,34%	10,13%	96.317,84	1.219.553,75	0,65%	7,13%	142,01%

Investimentos x Meta Atuarial (Mês a Mês)



Investimentos x Meta Atuarial (Acumulado)





## Renda Fixa

CNPJ	Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior (R\$)	Aplicações (R\$)	Resgates / Amortizações (R\$)	Saldo no mês (R\$)	Retorno no mês (R\$)	Retorno no mês para o Instituto (%)	Retorno do fundo no mês (%)	VaR no Mês
10740670000106	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	4.067.426,80	1.130.606,81	2.188.260,77	3.046.448,51	36.675,67	1,22%	0,91%	0,03
00834074000123	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA PRÁTICO RENDA FIXA CURTO PRAZO	20.496,11	370.000,00	390.839,90	0,00	343,79	0,09%	0,76%	0,04
11060913000110	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	3.453.369,13	0,00	400.000,00	3.057.894,35	4.525,22	0,15%	0,11%	0,23
10577503000188	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	172.042,27	0,00	0,00	168.841,79	-3.200,48	-1,86%	-1,86%	1,01
14508605000100	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	1.016.248,42	0,00	0,00	1.017.732,44	1.484,02	0,15%	0,15%	0,25
21307581000189	BNB INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	465.129,69	0,00	0,00	469.726,26	4.596,57	0,99%	0,99%	0,04
03737206000197	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	454.815,93	0,00	0,00	459.483,57	4.667,64	1,03%	1,03%	0,05
23215097000155	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	4.438.446,56	0,00	0,00	4.456.370,34	17.923,78	0,40%	0,40%	0,13
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>14.087.974,91</b>	<b>1.500.606,81</b>	<b>2.979.100,67</b>	<b>12.676.497,26</b>	<b>67.016,21</b>	<b>0,53%</b>		

## Renda Variável

CNPJ	Ativos Renda Variável	Saldo Anterior (R\$)	Aplicações (R\$)	Resgates / Amortizações (R\$)	Saldo no mês (R\$)	Retorno no mês (R\$)	Retorno no mês para o Instituto (%)	Retorno do fundo no mês (%)	VaR no Mês
30068169000144	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV DE AÇÕES CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	601.523,45	0,00	0,00	600.795,09	-728,36	-0,12%	-0,12%	2,01
15154220000147	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	297.604,34	0,00	0,00	289.071,48	-8.532,86	-2,87%	-2,87%	2,37
<b>Total Renda Variável</b>		<b>899.127,79</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>889.866,57</b>	<b>-9.261,22</b>	<b>-1,03%</b>		

## Estruturados

CNPJ	Ativos Estruturados	Saldo Anterior (R\$)	Aplicações (R\$)	Resgates / Amortizações (R\$)	Saldo no mês (R\$)	Retorno no mês (R\$)	Retorno no mês para o Instituto (%)	Retorno do fundo no mês (%)	VaR no Mês
30036235000102	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LONGO PRAZO	356.300,16	0,00	0,00	340.414,14	-15.886,02	-4,46%	-4,46%	1,26
03737188000143	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO	603.030,53	0,00	0,00	608.476,12	5.445,59	0,90%	0,90%	0,45
14120520000142	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO LONGO PRAZO	448.797,90	0,00	0,00	452.638,65	3.840,75	0,86%	0,86%	0,01
<b>Total Estruturados</b>		<b>1.408.128,59</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.401.528,91</b>	<b>-6.599,68</b>	<b>-0,47%</b>		

## Desenquadrado

CNPJ	Ativos Desenquadrados	Saldo Anterior (R\$)	Aplicações (R\$)	Resgates / Amortizações (R\$)	Saldo no mês (R\$)	Retorno no mês (R\$)	Retorno no mês para o Instituto (%)	Retorno do fundo no mês (%)	VaR no Mês
50803936000129	FDO DE INV EM COTAS DE FDOS DE INV CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	54.168,03	44.214,24	10.025,52	71,73	0,72%	0,70%	0,03
<b>Total Desenquadrado</b>		<b>0,00</b>	<b>54.168,03</b>	<b>44.214,24</b>	<b>10.025,52</b>	<b>71,73</b>	<b>0,72%</b>		

## Outros Cometários

CONSIDERANDO o Programa de Certificação Institucional e Modernização da Gestão dos Regimes Próprios de Previdência Social da União, dos Estados, do Distrito Federal e dos Municípios, criada por meio da Portaria MPS n° 185/2015, bem como as normas da SPREV e Conselho Monetário Nacional;

CONSIDERANDO a dimensão 3.2.6 do referido manual do Pró-Gestão que trata de Política de Investimentos, onde deverão ser observadas cautelas que mitiguem riscos, orientando que o RPPS elaborem relatórios mensais, acompanhados de parecer do Comitê de Investimentos e aprovação do Conselho Fiscal, de acompanhamento da rentabilidade e dos 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;

CONSIDERANDO que o Comitê de Investimentos e o Conselho Fiscal deste RPPS possui respaldo legal de sua criação conforme normativos do RPPS;

CONSIDERANDO que foram examinadas todas as informações contidas neste Relatório de Gestão de Investimentos, inclusive referente a performance, riscos, liquidez adequação e aderência às normas legais e Política de Investimentos;

CONSIDERANDO que não foram verificadas deficiências, inconsistências ou desenquadramentos na carteira de investimentos, aprovamos o referido relatório.

## Disclaimer

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pelo Atlas RPPS, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. O Atlas RPPS, titular desta marca ou qualquer das empresas de seu grupo empresarial não são responsáveis por tomadas de decisão e consequentes resultados. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias e Mensais.